



2026/1872

12.8.2026

IZVEDBENA UREDBA KOMISIJE (EU) 2026/1872

z dne 29. julija 2026

o spremembi izvedbenih tehničnih standardov iz Izvedbene uredbe Komisije (EU) 2016/2070 v zvezi z portfelji za primerjanje ter predlogami in navodili za poročanje, ki se v Uniji uporabljajo za poročanje iz člena 78(2) Direktive 2013/36/EU Evropskega parlamenta in Sveta

(Besedilo velja za EGP)

EVROPSKA KOMISIJA JE –

ob upoštevanju Pogodbe o delovanju Evropske unije,

ob upoštevanju Direktive 2013/36/EU Evropskega parlamenta in Sveta z dne 26. junija 2013 o dostopu do dejavnosti kreditnih institucij in bonitetnem nadzoru kreditnih institucij, spremembi Direktive 2002/87/ES in razveljavitvi direktiv 2006/48/ES in 2006/49/ES ⁽¹⁾ ter zlasti člena 78(8), četrty pododstavek, Direktive,

ob upoštevanju naslednjega:

- (1) Z Direktivo (EU) 2024/1619 Evropskega parlamenta in Sveta ⁽²⁾ je bila spremenjena Direktiva 2013/36/EU, da bi se med drugim v navedeno direktivo vključile zahteve v zvezi z ESG tveganji in spremenile zahteve za nadzorniško primerjanje. Te spremembe bi bilo treba upoštevati v Izvedbeni uredbi Komisije (EU) 2016/2070 ⁽³⁾.
- (2) Z Delegirano uredbo Komisije (EU) 2025/1496 ⁽⁴⁾ je bil spremenjen člen 520a Uredbe (EU) št. 575/2013 Evropskega parlamenta in Sveta ⁽⁵⁾, da bi se odložila uporaba standardov temeljnega pregleda trgvalne knjige za izračun kapitalskih zahtev za tržno tveganje. Posledica navedene spremembe je, da morajo institucije do 1. januarja 2027 še naprej uporabljati okvir tržnega tveganja iz različice Uredbe (EU) št. 575/2013, ki je veljala 8. julija 2024. Iz tega sledi, da bi morale področje uporabe postopka primerjanja začasno ostati omejeno na institucije, ki imajo dovoljenje za uporabo notranjih pristopov (pristop notranjih modelov) iz člena 78(1), točka (a), Direktive 2013/36/EU.
- (3) Poleg tega je primerno, da je zbiranje podatkov za institucije, ki uporabljajo pristop notranjih modelov in spadajo na področje izvajanja analize tržnega tveganja, omejeno na elemente alternativnega standardiziranega pristopa do 1. januarja 2027. To bi znatno zmanjšalo breme za sodelujoče institucije v tem obdobju, vendar bi še vedno zagotavljalo primerljivost letnih zbiranj podatkov in zagotovilo podatke, za katere nadzorniki menijo, da so najbolj koristni.

⁽¹⁾ UL L 176, 27.6.2013, str. 338, ELI: <http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj>.

⁽²⁾ Direktiva (EU) 2024/1619 Evropskega parlamenta in Sveta z dne 31. maja 2024 o spremembi Direktive 2013/36/EU v zvezi z nadzorniškimi pooblastili, sankcijami, podružnicami iz tretjih držav in okoljskimi, socialnimi in upravljavskimi tveganji (UL L, 2024/1619, 19.6.2024, ELI: <http://data.europa.eu/eli/dir/2024/1619/oj>).

⁽³⁾ Izvedbena uredba Komisije (EU) 2016/2070 z dne 14. septembra 2016 o določitvi izvedbenih tehničnih standardov za predloge, opredelitve in rešitve s področja informacijske tehnologije, ki jih institucije uporabljajo za poročanje Evropskemu bančnemu organu in pristojnim organom v skladu s členom 78(2) Direktive 2013/36/EU Evropskega parlamenta in sveta (UL L 328, 2.12.2016, str. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

⁽⁴⁾ Delegirana uredba Komisije (EU) 2025/1496 z dne 12. junija 2025 o spremembi Uredbe (EU) št. 575/2013 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z datumom začetka uporabe kapitalskih zahtev za tržno tveganje (UL L, 2025/1496, 19.9.2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1496/oj).

⁽⁵⁾ Uredba (EU) št. 575/2013 Evropskega parlamenta in Sveta z dne 26. junija 2013 o bonitetnih zahtevah za kreditne institucije in o spremembi Uredbe (EU) št. 648/2012 (UL L 176, 27.6.2013, str. 1, ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj>).

- (4) Izvedbena uredba Komisije (EU) 2024/3117 ⁽⁶⁾ vsebuje predloge za nadzorniško poročanje o uporabi pristopa IRB za kreditno tveganje. Zato je primerno zagotoviti, da so za postopek primerjanja kreditnega tveganja kategorije izpostavljenosti, ki se uporabljajo za določanje portfeljev za primerjanje, usklajene z razčlenitvijo, ki ji sledijo predloge IRB za kreditno tveganje iz navedene izvedbene uredbe.
- (5) Izvedbeno uredbo (EU) 2016/2070 bi bilo zato treba ustrezno spremeniti.
- (6) Ta uredba temelji na osnutku izvedbenih tehničnih standardov, ki ga je EBA predložil Komisiji.
- (7) EBA je opravil odprta javna posvetovanja o osnutku izvedbenih tehničnih standardov, na katerem temelji ta uredba, analiziral potencialne povezane stroške in koristi ter prosil za nasvet interesno skupino za bančništvo, ustanovljeno v skladu s členom 37 Uredbe (EU) št. 1093/2010 Evropskega parlamenta in Sveta ⁽⁷⁾ –

SPREJELA NASLEDNJO UREDBO:

Člen 1

Izvedbena uredba (EU) 2016/2070 se spremeni:

- (1) Priloga II se nadomesti z besedilom iz Priloge I k tej uredbi;
- (2) Priloga V se nadomesti z besedilom iz Priloge II k tej uredbi;
- (3) Priloga VI se nadomesti z besedilom iz Priloge III k tej uredbi;
- (4) Priloga VII se nadomesti z besedilom iz Priloge IV k tej uredbi;
- (5) Priloga X se nadomesti z besedilom iz Priloge V k tej uredbi.

Člen 2

Ta uredba začne veljati dvajseti dan po objavi v *Uradnem listu Evropske unije*.

Ta uredba je v celoti zavezujoča in se neposredno uporablja v vseh državah članicah.

V Bruslju, 29. julija 2026

*Za Komisijo
predsednica*

Ursula VON DER LEYEN

⁽⁶⁾ Izvedbena uredba Komisije (EU) 2024/3117 z dne 29. novembra 2024 o določitvi izvedbenih tehničnih standardov za uporabo Uredbe (EU) št. 575/2013 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z nadzorniškimi poročanji institucij in razveljavitvi Izvedbene uredbe Komisije (EU) 2021/451 (UL L, 2024/3117, 27.12.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2024/3117/oj).

⁽⁷⁾ Uredba (EU) št. 1093/2010 Evropskega parlamenta in Sveta z dne 24. novembra 2010 o ustanovitvi Evropskega nadzornega organa (Evropski bančni organ) in o spremembi Sklepa št. 716/2009/ES ter razveljavitvi Sklepa Komisije 2009/78/ES (UL L 331, 15.12.2010, str. 12, ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj>).

PRILOGA I

„PRILOGA II

PORTFELJI ZA NADZORNIŠKO PRIMERJANJE

OPREDELITEV PORTFELJEV ZA NADZORNIŠKO PRIMERJANJE	4
C 101.00 – Opredelitev nasprotnih strank v portfeljih z majhnim številom neplačnikov	4
C 102.00 – Opredelitev portfeljev z majhnim številom neplačnikov (LDP)	5
Uporabi se naslednje razporejanje med kategorijami izpostavljenosti in razčlenitvijo predloge CR IRB:	
C 103.00 – Opredelitev portfeljev z velikim številom neplačnikov (HDP)	12
Uporabi se naslednje razporejanje med kategorijami izpostavljenosti in razčlenitvijo predloge IRB za kreditno tveganje:	
C 104.00 – Opredelitev portfeljev z velikim številom neplačnikov za predloge na podlagi MSRP 9	15

OPREDELITEV PORTFELJEV ZA NADZORNIŠKO PRIMERJANJE

Pri vzporejanju izpostavljenosti institucij do nasprotnih strank in v portfelje iz Priloge I institucija uporabi stolpce, oznake, pravne sklice in navodila v tej prilogi.

Kjer se v Prilogi I uporabi ‚ni relevantno‘, za spremenljivko, na katero se nanaša, ni potrebna nobena posebna razdelitev.

C 101.00 – Opredelitev nasprotnih strank v portfeljih z majhnim številom neplačnikov

V Prilogi III, predloga C 101.00, se poročajo samo izpostavljenosti do nasprotnih strank, navedenih v Prilogi I, razpredelnica C 101.00, ki se obravnavajo po temeljnem pristopu IRB ali naprednem pristopu IRB. V Prilogi VIII, predloge C 111.00, C 112.00 in C 113.00, se poročajo tudi izpostavljenosti do nasprotnih strank, navedenih v Prilogi I, razpredelnica C 101.00, ki se obravnavajo po standardiziranem pristopu. Ne glede na regulativni pristop, se ne poročajo izpostavljenosti do povezanih subjektov nasprotnih strank iz Priloge I, razpredelnica C 101.00, vključno s podrejenimi in nadrejenimi družbami.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Koda nasprotne stranke		Sporoči se koda, ki jo EBA dodeli vsakemu pravnemu subjektu, ki je vključen v vzorec portfeljev z majhnim številom neplačnikov (LDP).
0020	Identifikator pravnih subjektov (LEI)		Alfnumerična koda iz 20 števk, ki povezuje ključne referenčne informacije, ki omogočajo jasno in edinstveno identifikacijo podjetij, ki sodelujejo na globalnih finančnih trgih.
0030	Koda kreditnega registra		Koda, ki jo uporablja nacionalni kreditni register v kraju sedeža nasprotne stranke. Koda se uporablja kot identifikator za nasprotno stranko.
0040	Koda poslovnega registra		Koda, ki jo nasprotni stranki dodeli javni poslovni register države, v kateri je nasprotna stranka registrirana.
0050	Koda ISIN		Mednarodna identifikacijska številka vrednostnega papirja, ki se uporablja za edinstveno identifikacijo vrednostnih papirjev, ki jih izda nasprotna stranka.
0060	Bloomberg ticker		Niz znakov ali števil, ki se uporablja za edinstveno identifikacijo podjetja ali subjekta pri Bloombergu.
0070	Naziv		Naziv pravnega subjekta, ki je vključen v vzorce portfeljev z majhnim številom neplačnikov.
0080	Geografsko območje		Država sedeža (oznaka ISO ali ‚druge države‘) nasprotne stranke (0010).
0090	Naziv portfelja		Vzorec, v katerega je razvrščena nasprotna stranka (0010), ki je en od naslednjih: (a) vzorec držav; (b) vzorec institucij; (c) vzorec velikih podjetij.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0100	Sektor nasprotne stranke	Priloga VI k Izvedbeni uredbi Komisije (EU) 2021/451	Relevantni gospodarski sektor, v katerega je razvrščena nasprotna stranka (0010), ki je en od naslednjih: (a) centralne banke; (b) sektor država; (c) kreditne institucije; (d) druge finančne družbe; (e) nefinančne družbe; (f) gospodinjstva; (g) ni relevantno. Razvrstitev nasprotnih strank v sektorje se izvede v skladu z navodili iz Priloge V, oddelek 1, točka 42, k Izvedbeni uredbi Komisije (EU) 2021/451 za vse nasprotne stranke, razen za ‚Evropsko investicijsko banko‘, ki se dodeli pod (b) sektor država, ker se obravnava kot multilateralna razvojna banka v skladu s členom 117(2), točka (j), Uredbe (EU) št. 575/2013.
0110	Vrsta izpostavljenosti		V Prilogi III, predloga C 101.00, se poročajo samo izpostavljenosti, ki niso iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev.
0120	Vrsta instrumenta		Ni relevantno: izpostavljenosti se poročajo v Prilogi III, predloga C 101.00 ne glede na vrsto instrumenta.
0130	Vrsta tveganja		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi vrste tveganja: (a) kreditno tveganje nasprotne stranke; (b) kreditno tveganje in proste izročitve; (c) kreditno tveganje, kreditno tveganje nasprotne stranke in proste izročitve.
0140	Regulativni pristop		Izpostavljenosti do nasprotnih strank se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi regulativnega pristopa, ki se uporablja za izračun RWA: (a) temeljni pristop IRB; (b) napredni pristop IRB; (c) standardizirani pristop.

C 102.00 Opredelitev portfeljev z majhnim številom neplačnikov (LDP)

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	ID portfelja		Edinstvena identifikacijska koda, ki jo portfelju dodeli EBA.
0020	Naziv portfelja		Vsakemu portfelju se dodeli eden od naslednjih nazivov portfelja: (a) država; (b) institucije; (c) velika podjetja; (d) izpostavljenosti iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev, ki zajemajo vse izpostavljenosti, opredeljene v členu 147(2)(c)(ii) in členu 147(8) Uredbe (EU) št. 575/2013.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0030	Vrsta tveganja		Uporabljajo se navodila za stolpec 0130 razpredelnice C 101.00.
0040	Regulativni pristop		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi regulativnega pristopa, ki se uporablja za izračun RWA: (a) temeljni pristop IRB; (b) napredni pristop IRB; (c) merila za razporejanje posebnih kreditnih aranžmajev.
0050	Geografsko območje		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi države sedeža (oznaka ISO ali 'druge države') dolžnika.
0060	Bonitetna ocena	Člen 153(5) Uredbe (EU) št. 575/2013	Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi razvrstitev glede na notranjo bonitetno oceno, ki jo uporablja institucija, in sicer od najnižjega do najvišjega tveganja, brez razredov z verjetnostjo neplačila (PD) 100 %. Za razvrstitev se uporabijo vrednosti bonitetna ocena 1, bonitetna ocena 2 itd.
		Predloga C 08.02 Priloge I k Izvedbeni uredbi Komisije (EU) 2024/3117 in povezana navodila.	Kadar institucija poročevalka uporablja edinstven bonitetni sistem ali je zmožna poročati v skladu z notranjo skupno bonitetno lestvico, se uporabi ta lestvica. V vseh drugih primerih se različni bonitetni sistemi združijo in navedejo v skladu z naslednjimi navodili: (a) bonitetni razredi dolžnika različnih bonitetnih sistemov se združijo in navedejo od nižje verjetnosti neplačila, dodeljene vsakemu bonitetnemu razredu dolžnika, do višje; (b) kadar se uporablja veliko število ocen ali razredov, se lahko s pristojnimi organi dogovori o manjšem številu ocen ali razredov za poročanje.
			Za izpostavljenosti iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev, ki se jim dodeli utež tveganja v skladu s pristopom iz člena 153(5) Uredbe Komisije (EU) št. 575/2013, razdelitev bonitetnih ocen temelji na kategoriji nadzorniške uteži tveganja v skladu z razpredelnico 1 navedenega člena, kot sledi: (a) bonitetna ocena 1: kategorija 1 s preostalo zapadlostjo manj kot 2,5 leta; (b) bonitetna ocena 2: kategorija 2 s preostalo zapadlostjo manj kot 2,5 leta; (c) bonitetna ocena 3: kategorija 3 s preostalo zapadlostjo manj kot 2,5 leta; (d) bonitetna ocena 4: kategorija 4 s preostalo zapadlostjo manj kot 2,5 leta; (e) bonitetna ocena 5: kategorija 1 s preostalo zapadlostjo enako ali več kot 2,5 leta; (f) bonitetna ocena 6: kategorija 2 s preostalo zapadlostjo enako ali več kot 2,5 leta; (g) bonitetna ocena 7: kategorija 3 s preostalo zapadlostjo enako ali več kot 2,5 leta; (h) bonitetna ocena 8: kategorija 4 s preostalo zapadlostjo enako ali več kot 2,5 leta. Uporabi se bonitetna lestvica, ki se uporabi za poročanje v Prilogi I, predloga C 08.02, k Izvedbeni uredbi (EU) 2021/451. Če institucija uporablja skupno bonitetno lestvico skupine, se uporabi ta lestvica.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila																
0070	Kategorija izpostavljenosti	Priloga II, odstavek 76, k Izvedbeni uredbi (EU) 2021/451	Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi kategorije izpostavljenosti: (a) izpostavljenosti do enot centralne ravni države in centralnih bank; (b) izpostavljenosti do institucij; (c) za izpostavljenost do podjetij v portfeljih z majhnim številom neplačnikov: (c.1) izpostavljenosti do podjetij – splošno; (c.2) izpostavljenosti do podjetij – izpostavljenosti iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev; (e) ni relevantno. Uporabi se naslednje razporejanje med kategorijami izpostavljenosti in razčlenitvijo predloge CR IRB:																
			<table><tr><th rowspan="2">Kategorija izpostavljenosti</th><th>Koda v identifikacijski oznaki portfelja</th><th rowspan="2">(*)</th></tr><tr><th></th></tr><tr><td>(a) izpostavljenosti do enot centralne ravni države in centralnih bank;</td><td>GOVT</td><td>A.2, B.2</td></tr><tr><td>(b) izpostavljenosti do institucij;</td><td>INST</td><td>A.3, A.4, A.5, B.3, B.4</td></tr><tr><td>(c.1) izpostavljenosti do podjetij – splošno;</td><td>LCOR</td><td>A.6.2, A.6.3, B.5.2, B.5.3</td></tr><tr><td>(c.2) izpostavljenosti do podjetij – izpostavljenosti iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev;</td><td>COSP</td><td>A.6.1, B.5.1</td></tr></table>	Kategorija izpostavljenosti	Koda v identifikacijski oznaki portfelja	(*)		(a) izpostavljenosti do enot centralne ravni države in centralnih bank;	GOVT	A.2, B.2	(b) izpostavljenosti do institucij;	INST	A.3, A.4, A.5, B.3, B.4	(c.1) izpostavljenosti do podjetij – splošno;	LCOR	A.6.2, A.6.3, B.5.2, B.5.3	(c.2) izpostavljenosti do podjetij – izpostavljenosti iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev;	COSP	A.6.1, B.5.1
Kategorija izpostavljenosti	Koda v identifikacijski oznaki portfelja	(*)																	
(a) izpostavljenosti do enot centralne ravni države in centralnih bank;	GOVT	A.2, B.2																	
(b) izpostavljenosti do institucij;	INST	A.3, A.4, A.5, B.3, B.4																	
(c.1) izpostavljenosti do podjetij – splošno;	LCOR	A.6.2, A.6.3, B.5.2, B.5.3																	
(c.2) izpostavljenosti do podjetij – izpostavljenosti iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev;	COSP	A.6.1, B.5.1																	
			(*) Izvedbena uredba Komisije (EU) 2024/3117 z dne 29. novembra 2024 o določitvi izvedbenih tehničnih standardov za uporabo Uredbe (EU) št. 575/2013 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z nadzorniškim poročanjem institucij in razveljavitvi Izvedbene uredbe Komisije (EU) 2021/451 (UL L 2024/3117, 27.12.2024), Priloga II: Navodila za poročanje o kapitalskih zahtevah, del II: Navodila v zvezi s predlogo, oddelek 3.3.2 V skladu s členom 147(3a) Uredbe (EU) št. 575/2013 se izpostavljenosti do enot regionalne in lokalne ravni držav ter izpostavljenosti do oseb javnega sektorja, ki se obravnavajo kot izpostavljenosti do enot centralne ravni držav, razvrstijo v kategorijo izpostavljenosti (a) izpostavljenosti do enot centralne ravni države in centralnih bank. Kategorije izpostavljenosti ‚izpostavljenosti iz naslova lastniških instrumentov‘, ‚izpostavljenosti iz naslova enot ali deležev v KNP‘, ‚postavke iz naslova pozicij v listinjenju‘ in ‚druga sredstva iz naslova nekreditnih obveznosti‘ iz člena 147(2), točke (e), (ea), (f) in (g), Uredbe (EU) št. 575/2013 se ne poročajo.																

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0080	Sektor nasprotne stranke	Priloga VI k Izvedbeni uredbi (EU) 2021/451	Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi relevantnega gospodarskega sektorja. (a) centralne banke; (b) sektor država; (c) kreditne institucije; (d) druge finančne družbe; (e) nefinančne družbe; (f) gospodinjstva; (g) ni relevantno. Razvrstitev nasprotnih strank v sektorje se izvede v skladu z navodili v Prilogi V, oddelek 1, točka 42, k Izvedbeni uredbi Komisije (EU) 2021/451.
0090	Status glede neplačil		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi statusa glede neplačil v skladu s členom 178 Uredbe (EU) št. 575/2013: (a) neplačane izpostavljenosti (<i>defaulted</i>), (b) izpostavljenosti, ki niso neplačane (<i>non-defaulted</i>). (c) ni relevantno.
0100	Vrsta instrumenta	Člen 166(8) in (10) Uredbe (EU) št. 575/2013	Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi vrste instrumenta. Če se za kreditni produkt uporablja več kot ena vrednost za vrsto instrumenta, se vrednost izpostavljenosti razdeli na podlagi vrednosti za vrsto instrumenta. Vrsta instrumenta je ena izmed naslednjih: (a) visoko tveganje (100 %); (b) prevzeta obveznost iz naslova odkupa neprodanih kratkoročnih in srednjeročnih evrozapisov (NIF) in obnavljajoča se prevzeta obveznost iz naslova kreditiranja poslovanja na trgu kratkoročnih in srednjeročnih evrozapisov (RUF) (srednje tveganje); (c) izdane garancije in zavarovanja odgovornosti, jamstva, nepreklicni 'stand-by' akreditivi, dokumentarni akreditivi ter druge zunajbilančne postavke (srednje tveganje), vključno z garancijami za resnost ponudbe, garancijami za dobro izvedbo del, garancijami za plačilo carinskega dolga in garancijami za plačilo davka, jamstvi, nepreklicnimi 'stand-by' akreditivi, ki nimajo lastnosti kreditnih nadomestkov, in drugimi zunajbilančnimi postavkami s srednjim tveganjem; (d) nečrpana obnavljajoča se odobrena prevzeta kreditna obveznost (srednje do nizko tveganje) (<i>undrawn committed revolving credit facility</i>), vključno z obnavljajočimi se kreditnimi obveznostmi, ki niso črpane in ki jih ni mogoče kadar koli brezpogojno preklicati brez predhodnega obvestila ali ki ne omogočajo samodejnega preklica zaradi poslabšanja kreditne sposobnosti kreditnojemalca; (e) nečrpana odobrena termimska kreditna obveznost (srednje do nizko tveganje) (<i>undrawn committed term credit facility</i>), vključno s terminskimi kreditnimi obveznostmi, ki niso črpane in ki jih ni mogoče kadar koli brezpogojno preklicati brez predhodnega obvestila ali ki ne omogočajo samodejnega preklica zaradi poslabšanja kreditne sposobnosti kreditnojemalca; (f) nečrpana odobrena druga prevzeta kreditna obveznost (srednje do nizko tveganje) (<i>undrawn committed other credit facility</i>), vključno s kreditnimi obveznostmi, ki niso obnavljajoče se ali terminske, ki niso črpane in ki jih ni mogoče kadar koli brezpogojno preklicati brez predhodnega obvestila ali ki ne omogočajo samodejnega preklica zaradi poslabšanja kreditne sposobnosti kreditnojemalca;

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			(g) izdani kratkoročni akreditivi in druge zunajbilančne postavke s srednjim do nizkim tveganjem (srednje do nizko tveganje); (h) nečrpane neodobrene kreditne linije (nizko tveganje), vključno s kreditnimi linijami, ki niso črpane in ki jih je mogoče kadar koli brezpogojno preklicati brez predhodnega obvestila ali ki omogočajo samodejni preklic zaradi poslabšanja kreditne sposobnosti kreditjemalca; (i) neizkoriščene nakupne obveznosti za obnavljajoče se odkupljene terjatve in druge zunajbilančne postavke z nizkim tveganjem (nizko tveganje), vključno z obveznostmi, ki jih je mogoče kadar koli brezpogojno preklicati ali ki dejansko določajo, da jih lahko institucija kadar koli samodejno prekliče brez predhodnega obvestila; (j) ni relevantno.
0110	Status zavarovanja s premoženjem	Predloga C08.01, stolpci 150 do 220, Priloge I k Izvedbeni uredbi Komisije (EU) 2024/3117 in povezana navodila.	Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi statusa zavarovanja s premoženjem za vsak del: (a) izpostavljenosti s kreditnim zavarovanjem; (b) izpostavljenosti brez kreditnega zavarovanja; (c) ni relevantno. Del izpostavljenosti s kreditnim zavarovanjem se določi z vrednostjo zavarovanja s premoženjem po odbitkih, ki se uporabijo v skladu z delom 3, naslov II, poglavje 4, oddelek 4, Uredbe (EU) št. 575/2013 in, kadar je ustrezno, notranjimi smernicami institucij.
0120	Vrsta zavarovanja s premoženjem	Predloga C08.01, stolpci 0040 do 0060 in 0150 do 0220, Priloge I k Izvedbeni uredbi Komisije (EU) 2024/3117 ter povezana navodila.	Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi vrste zavarovanja s premoženjem: (a) primerno zavarovanje s finančnim premoženjem (predloga C 08.01, stolpec 0180); (b) drugo primerno zavarovanje s premoženjem: denarne terjatve (predloga C 08.01, stolpec 0210); (c) drugo primerno zavarovanje s premoženjem: stanovanjske nepremičnine (predloga C 08.01, stolpec 0190); (d) drugo primerno zavarovanje s premoženjem: poslovne nepremičnine (predloga C 08.01, stolpec 0190); (e) drugo primerno zavarovanje s premoženjem: primerno zavarovanje s finančnim premoženjem (predloga C 08.01, stolpec 0200); (f) drugo stvarno kreditno zavarovanje (predloga C 08.01, stolpca 0060 in 0170); (g) kreditni izvedeni finančni instrumenti (predloga C 08.01, stolpca 0050 in 0160); (h) jamstva (predloga C 08.01, stolpca 0040 in 0150); (i) ni relevantno. Del izpostavljenosti, zavarovan z določeno vrsto zavarovanja s premoženjem, se določi z vrednostjo te določene vrste zavarovanja s premoženjem po uporabi zahtevanih odbitkov v skladu z delom 3, naslov II, poglavje 4, oddelek 4, Uredbe (EU) št. 575/2013 in, kadar je ustrezno, z notranjimi smernicami institucij.
0130	Nasprotna stranka		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi vrste nasprotne stranke: (a) subjekti javnega sektorja (člen 4, točki 1 in 8, Uredbe (EU) št. 575/2013); (b) nasprotne stranke, ki niso subjekti javnega sektorja; (c) ni relevantno.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0140	Velikost nasprotne stranke		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi velikosti nasprotne stranke, ki se določi na podlagi skupnega letnega prometa za konsolidirano skupino, katere del je nasprotna stranka: (a) ≤ 50 milijonov EUR; (b) > 50 milijonov EUR in ≤ 200 milijonov EUR; (c) > 200 milijonov EUR; (d) > 200 milijonov EUR in ≤ 500 milijonov EUR; (e) > 500 milijonov EUR; (f) ni relevantno. Skupni letni promet se izračuna v skladu s Prilogo, člen 4, k Priporočilu Komisije 2003/361/ES in se nanaša na leto, ki se konča eno leto pred referenčnim datumom poročanja.
0150	Oznaka NACE		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi gospodarske dejavnosti nasprotne stranke, določene s statistično klasifikacijo gospodarskih dejavnosti v Evropski uniji (NACE Revizija 2), določeno v Uredbi (ES) št. 1893/2006^{***}: (a) NACE 1: C Predelovalne dejavnosti; (b) NACE 2: G Trgovina; (c) NACE 3: F Gradbeništvo; (d) NACE 4: H Promet in skladiščenje; (e) NACE 5: D Oskrba z električno energijo, plinom, paro in hladnim zrakom; (f) NACE 6: A Kmetijstvo in lov, gozdarstvo in ribištvo; (g) NACE 7: L Poslovanje z nepremičninami; (h) NACE 8: vse druge izpostavljenosti, razen tistih iz točk (a) do (g) zgoraj; (i) ni relevantno.
0160	Vrsta izpostavljenosti	Člen 147(8) Uredbe (EU) št. 575/2013	Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi vrste izpostavljenosti: (a) ni relevantno; (b) izpostavljenosti iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev – financiranje projektov; (c) izpostavljenosti iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev – nepremičnine, ki ustvarjajo dohodke, in poslovne nepremičnine z visoko nestanovitnostjo stopnje izgub; (d) izpostavljenosti iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev – financiranje fizičnih sredstev; (e) izpostavljenosti iz naslova posebnih kreditnih aranžmajev – financiranje blaga; (f) primerne krite obveznice, ki izpolnjujejo zahteve iz člena 129(1) Uredbe (EU) št. 575/2013; (g) druge izpostavljenosti, razen tistih iz točk (b) do (f).
0170	Velikost izpostavljenosti	Predloga C08.01, stolpec 0110, Priloge I k Izvedbeni uredbi Komisije (EU) 2024/3117 in povezana navodila.	Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi velikosti izpostavljenosti, izražene kot vrednost izpostavljenosti (tj. vrednost izpostavljenosti ob neplačilu – EAD): (a) ni relevantno.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0180	Indeksirani razpon razmerja med posojilom in vrednostjo nepremičnine		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi indeksiranega razpona razmerja med posojilom in vrednostjo nepremičnine (ILTV), ki je razmerje med trenutnim zneskom posojila in trenutno vrednostjo nepremičnine: (a) skupina 1: $\leq 55\%$, če je nepremičnina stanovanjska nepremičnina; $\leq 60\%$, če je nepremičnina poslovna nepremičnina, (b) skupina 2: $> 55\% \leq 70\%$, če je nepremičnina stanovanjska nepremičnina; $> 60\% \leq 70\%$, če je nepremičnina poslovna nepremičnina; (c) skupina 3: $> 70\% \leq 80\%$; (d) skupina 4: $> 80\% \leq 90\%$; (e) skupina 5: $> 90\% \leq 100\%$; (f) skupina 6: $> 100\% \leq 110\%$; (g) skupina 7: $> 110\%$; (h) ni relevantno. Indeksirani razpon razmerja med posojilom in vrednostjo nepremičnine se izračuna na preudaren način in je skladen z naslednjimi zahtevami: (a) skupni znesek posojila: neporavnani znesek hipotekarnega posojila skupaj s kakršnim koli nečrpanim odobrenim zneskom hipotekarnega posojila (po uporabi ustreznega kreditnega konverzijskega faktorja). Znesek posojila se izračuna pred upoštevanjem vseh posebnih popravkov zaradi kreditnega tveganja in vključuje vsa druga posojila (vključno s tistimi, ki so instituciji znana in jih zagotovijo druge finančne institucije), zavarovana z zastavnimi pravicami z enako ali višjo prednostjo na isti stanovanjski nepremičnini glede na zastavno pravico, s katero se zavaruje posojilo. Kadar ni dovolj informacij za določitev prednosti drugih zastavnih pravic, institucija predpostavi, da so navedene zastavne pravice enakovredne zastavni pravici, s katero je zavarovano posojilo; (b) vrednost nepremičnine: vrednost nepremičnine se dobi z najnovejšim neodvisnim vrednotenjem nepremičnine in se v trenutno vrednost pretvori tako, da se uporabi indeks cen nepremičnin. Vrednotenje je neodvisno in ga opravijo kvalificirani cenilci. Zahteve glede kvalifikacij in minimalni standardi ocenjevanja so skladni z naslednjimi zahtevami: (i) obstaja ločena ocena nepremičnine in nepremičnina je vrednotena razumno konzervativno (npr. brez pričakovanih prihodnjih rasti cen in ob upoštevanju možnosti, da je trenutna cena nepremičnine nad ravno, ki je vzdržna v času trajanja posojila, npr. zaradi nepremičninskega balona); (ii) kadar je mogoče določiti tržno vrednost, vrednotenje ni višje od tržne vrednosti; (iii) vrednotenje je podprto z ustrežno cennitveno dokumentacijo.
0190	Pripoznanje v bilanci stanja		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi pripoznanja v bilanci stanja: (a) bilančne postavke; (b) zunajbilančne postavke; (c) drugo; (d) ni relevantno. Izpostavljenosti, ki predstavljajo posle financiranja z vrednostnimi papirji, izvedene finančne instrumente in posle z dolгим rokom poravnave ali pobot med različnimi kategorijami produktov ter ki so predmet kreditnega tveganja nasprotne stranke, se razporedijo pod točko (c). Te izpostavljenosti se ne poročajo v točkah (a) ali (b).

C 103.00 – Opredelitev portfeljev z velikim številom neplačnikov (HDP)

Stolpec		Pravna podlaga	Navodila
0010	ID portfelja		Edinstvena identifikacijska koda, ki jo EBA dodeli vsakemu portfelju.
0020	Naziv portfelja		Vsakemu portfelju se dodeli eden od naslednjih nazivov portfelja: 1.0 CORP 1.1 CORP Neplačane izpostavljenosti 1.2 CORP Izpostavljenosti, ki niso neplačane 2.0 SMEC 2.1 SMEC Neplačane izpostavljenosti 2.2 SMEC Izpostavljenosti, ki niso neplačane 3.0 Druge izpostavljenosti na drobno do MSP 3.1 Druge neplačane izpostavljenosti na drobno do MSP 3.2 Druge izpostavljenosti na drobno do MSP, ki niso neplačane 4.0 Izpostavljenosti do podjetij, ki niso MSP, zavarovane s hipotekami 4.1 Neplačane izpostavljenosti do podjetij, ki niso MSP, zavarovane s hipotekami 4.2 Izpostavljenosti do podjetij, ki niso MSP, ki niso neplačane, zavarovane s hipotekami 5.0 Izpostavljenosti do MSP, zavarovane s hipotekami 5.1 Neplačane izpostavljenosti do MSP, zavarovane s hipotekami 5.2 Izpostavljenosti do MSP, ki niso neplačane, zavarovane s hipotekami 6.0 Druge izpostavljenosti na drobno do podjetij, ki niso MSP 6.1 Druge neplačane izpostavljenosti na drobno do podjetij, ki niso MSP 6.2 Druge izpostavljenosti na drobno do podjetij, ki niso MSP, ki niso neplačane 7.0 QRRE 7.1 QRRE Neplačane izpostavljenosti 7.2 QRRE Izpostavljenosti, ki niso neplačane
0030	Vrsta tveganja		Uporabljajo se navodila za stolpec 0130 razpredelnice C 101.00.
0040	Regulativni pristop		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi regulativnega pristopa, ki se uporablja za izračun RWA: (a) temeljni pristop IRB; (b) napredni pristop IRB.
0050	Geografsko območje		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi države sedeža (oznaka ISO ali „druge države“) dolžnika. Za portfelje „Izpostavljenosti na drobno – MSP – Zavarovano z nepremičninami“ in „Izpostavljenosti na drobno – Podjetja, ki niso MSP – Zavarovano z nepremičnimi“ se izpostavljenosti razdelijo na dele glede na lokacijo zavarovanja s premoženjem.
0060	Bonitetna ocena		Uporabljajo se navodila za stolpec 0060 razpredelnice C 102.00.
0070	Kategorija izpostavljenosti		Izpostavljenosti se razdelijo na dele in razporedijo v portfelje na podlagi kategorije izpostavljenosti: (d) za izpostavljenost do podjetij v portfeljih z velikim številom neplačnikov: (d.1) izpostavljenosti do podjetij – MSP; (d.2) izpostavljenosti do podjetij – razen MSP; (e) za izpostavljenost na drobno:

Stolpec	Pravna podlaga	Navodila																										
		(e.1) izpostavljenosti na drobno – MSP; (e.1.1) izpostavljenosti na drobno – MSP – zavarovano z nepremičninami; (e.1.2) izpostavljenosti na drobno – MSP – drugo; (e.2) izpostavljenosti na drobno – razen MSP; (e.2.1) izpostavljenosti na drobno – razen MSP – drugo; (e.2.2) izpostavljenosti na drobno – razen MSP – zavarovano z nepremičninami; (e.3.3) izpostavljenosti na drobno – kvalificirane obnavljajoče se izpostavljenosti; (f) ni relevantno. Uporabi se naslednje razporejanje med kategorijami izpostavljenosti in razčlenitvijo predloge IRB za kreditno tveganje: <table> <tr> <th rowspan="2">Kategorija izpostavljenosti</th><th colspan="2">(*)</th></tr> <tr> <th>Oznaka portfelja</th><th></th></tr> <tr> <td>(d.1) izpostavljenosti do podjetij – MSP;</td><td>SMEC</td><td>A.6.2, A.6.3, B.5.2, B.5.3</td></tr> <tr> <td>(d.2) izpostavljenosti do podjetij – razen MSP;</td><td>CORP</td><td>A.6.2, A.6.3, B.5.2, B.5.3</td></tr> <tr> <td>(e.1.1) izpostavljenosti na drobno – MSP – zavarovano z nepremičninami;</td><td>RSMS</td><td>B.6.5</td></tr> <tr> <td>(e.1.2) izpostavljenosti na drobno – MSP – drugo;</td><td>SMOT</td><td>B.6.7, B.6.3 (**)</td></tr> <tr> <td>(e.2.1) izpostavljenosti na drobno – razen MSP – drugo;</td><td>RETO</td><td>B.6.8, B.6.3 (***)</td></tr> <tr> <td>(e.2.2) izpostavljenosti na drobno – razen MSP – zavarovano z nepremičninami;</td><td>MORT</td><td>B.6.6</td></tr> <tr> <td>(e.3.3) izpostavljenosti na drobno – kvalificirane obnavljajoče se izpostavljenosti;</td><td>RQRR</td><td>B.6.2</td></tr> </table> (*) Izvedbena uredba Komisije (EU) [2024/3117] z dne [29. novembra 2024] o določitvi izvedbenih tehničnih standardov za uporabo Uredbe (EU) št. 575/2013 Evropskega parlamenta in Sveta v zvezi z nadzorniškimi poročanjem institucij in razveljavitvi Izvedbene uredbe Komisije (EU) št. 2021/451 (UL L 2024/3117, 27.12.2024), Priloga II: Navodila za poročanje o kapitalskih zahtevah, del II: Navodila v zvezi s predlogo, oddelek 3.3.2 (**) Razen nasprotnih strank in njihovih izpostavljenosti, razvrščenih kot podjetja, ki niso MSP. (**) Razen nasprotnih strank in njihovih izpostavljenosti, razvrščenih kot podjetja, ki so MSP. Kategorije izpostavljenosti ‚izpostavljenosti iz naslova lastniških instrumentov‘, ‚izpostavljenosti iz naslova enot ali deležev v KNP‘, ‚postavke iz naslova pozicij v listinjenju‘ in ‚druga sredstva iz naslova nekreditnih obveznosti‘ iz člena 147(2), točke (e), (ea), (f) in (g), Uredbe (EU) št. 575/2013 se ne poročajo.	Kategorija izpostavljenosti	(*)		Oznaka portfelja		(d.1) izpostavljenosti do podjetij – MSP;	SMEC	A.6.2, A.6.3, B.5.2, B.5.3	(d.2) izpostavljenosti do podjetij – razen MSP;	CORP	A.6.2, A.6.3, B.5.2, B.5.3	(e.1.1) izpostavljenosti na drobno – MSP – zavarovano z nepremičninami;	RSMS	B.6.5	(e.1.2) izpostavljenosti na drobno – MSP – drugo;	SMOT	B.6.7, B.6.3 (**)	(e.2.1) izpostavljenosti na drobno – razen MSP – drugo;	RETO	B.6.8, B.6.3 (***)	(e.2.2) izpostavljenosti na drobno – razen MSP – zavarovano z nepremičninami;	MORT	B.6.6	(e.3.3) izpostavljenosti na drobno – kvalificirane obnavljajoče se izpostavljenosti;	RQRR	B.6.2
Kategorija izpostavljenosti	(*)																											
	Oznaka portfelja																											
(d.1) izpostavljenosti do podjetij – MSP;	SMEC	A.6.2, A.6.3, B.5.2, B.5.3																										
(d.2) izpostavljenosti do podjetij – razen MSP;	CORP	A.6.2, A.6.3, B.5.2, B.5.3																										
(e.1.1) izpostavljenosti na drobno – MSP – zavarovano z nepremičninami;	RSMS	B.6.5																										
(e.1.2) izpostavljenosti na drobno – MSP – drugo;	SMOT	B.6.7, B.6.3 (**)																										
(e.2.1) izpostavljenosti na drobno – razen MSP – drugo;	RETO	B.6.8, B.6.3 (***)																										
(e.2.2) izpostavljenosti na drobno – razen MSP – zavarovano z nepremičninami;	MORT	B.6.6																										
(e.3.3) izpostavljenosti na drobno – kvalificirane obnavljajoče se izpostavljenosti;	RQRR	B.6.2																										

Stolpec		Pravna podlaga	Navodila
0080	Sektor nasprotne stranke		Uporabljajo se navodila za stolpec 0100 razpredelnice C 102.00.
0090	Status glede neplačil		Uporabljajo se navodila za stolpec 0090 razpredelnice C 102.00.
0100	Vrsta instrumenta		Uporabljajo se navodila za stolpec 0120 razpredelnice C 102.00.
0110	Status zavarovanja s premoženjem		Uporabljajo se navodila za stolpec 0110 razpredelnice C 102.00.
0120	Vrsta zavarovanja s premoženjem		Uporabljajo se navodila za stolpec 0120 razpredelnice C 102.00.
0130	Nasprotna stranka		Uporabljajo se navodila za stolpec 0130 razpredelnice C 102.00.
0140	Velikost nasprotne stranke		Uporabljajo se navodila za stolpec 0140 razpredelnice C 102.00.
0150	Oznaka NACE		Uporabljajo se navodila za stolpec 0150 razpredelnice C 102.00.
0160	Vrsta izpostavljenosti		Uporabljajo se navodila za stolpec 0110 razpredelnice C 102.00.
0170	Velikost izpostavljenosti		Uporabljajo se navodila za stolpec 0170 razpredelnice C 102.00.
0180	Indeksirani razpon razmerja med posojilom in vrednostjo nepremičnine		Uporabljajo se navodila za stolpec 0180 razpredelnice C 102.00.
0190	Pripoznanje v bilanci stanja		Uporabljajo se navodila za stolpec 0190 razpredelnice C 102.00.

Stolpec		Pravna podlaga	Navodila
0200	Status zavarovanja s premoženjem po MSRP 9	MSRP 9, B.5.55. člen	Izpostavljenosti se razporedijo v portfelje na podlagi njihovega statusa zavarovanja s premoženjem, kot se uporablja za merjenje pričakovanih kreditnih izgub v skladu z MSRP 9: (a) izpostavljenosti z zavarovanjem s premoženjem. Ta portfelj vključuje vse izpostavljenosti, za katere v skladu s členom B5.5.55 MSRP 9 merjenje pričakovanih kreditnih izgub upošteva denarne tokove, ki se pričakujejo iz povezanega zavarovanja s premoženjem in/ali drugih izboljšav kreditne kakovosti, ki so del pogodbenih pogojev zadevne izpostavljenosti in jih podjetje ne pripoznava ločeno. Tiste izpostavljenosti, ki so le delno zavarovane s premoženjem, se v tem portfelju poročajo s polnim zneskom. (b) izpostavljenosti brez zavarovanja s premoženjem. Ta portfelj vključuje vse izpostavljenosti, pri katerih prisotnost zavarovanja s premoženjem ali katere koli druge oblike izboljšav kreditne kakovosti ne vpliva na merjenje povezanih pričakovanih kreditnih izgub. (c) ni relevantno.

C 104.00 – Opredelitev portfeljev z velikim številom neplačnikov za predloge na podlagi MSRP 9

Stolpec		Pravna podlaga	Navodila
0010	ID portfelja		Edinstvena identifikacijska koda, ki jo EBA dodeli vsakemu portfelju.
0020	Naziv portfelja		Uporabljajo se navodila za stolpec 0020 razpredelnice C 103.
0030	Vrsta tveganja		Uporabljajo se navodila za stolpec 0130 razpredelnice C 101.
0040	Regulativni pristop		Uporabljajo se navodila za stolpec 0140 razpredelnice C 101.
0050	Geografsko območje		Uporabljajo se navodila za stolpec 0080 razpredelnice C 101.
0060	Bonitetna ocena		Uporabljajo se navodila za stolpec 0060 razpredelnice C 102.
0070	Kategorija izpostavljenosti		Uporabljajo se navodila za stolpec 0070 razpredelnice C 103.
0080	Sektor nasprotne stranke		Uporabljajo se navodila za stolpec 0100 razpredelnice C 101.
0090	Status glede neplačil		Uporabljajo se navodila za stolpec 0090 razpredelnice C 102.

Stolpec		Pravna podlaga	Navodila
0100	Vrsta instrumenta		Uporabljajo se navodila za stolpec 0120 razpredelnice C 101.
0110	Status zavarovanja s premoženjem		Uporabljajo se navodila za stolpec 0110 razpredelnice C 102.
0120	Vrsta zavarovanja s premoženjem		Uporabljajo se navodila za stolpec 0120 razpredelnice C 102.
0130	Nasprotna stranka		Uporabljajo se navodila za stolpec 0130 razpredelnice C 102.
0140	Velikost nasprotne stranke		Uporabljajo se navodila za stolpec 0140 razpredelnice C 102.
0150	Oznaka NACE		Uporabljajo se navodila za stolpec 0150 razpredelnice C 102.
0160	Vrsta izpostavljenosti		Uporabljajo se navodila za stolpec 0110 razpredelnice C 101.
0170	Velikost izpostavljenosti		Uporabljajo se navodila za stolpec 0170 razpredelnice C 102.
0180	Indeksirani razpon razmerja med posojilom in vrednostjo nepremičnine		Uporabljajo se navodila za stolpec 0180 razpredelnice C 102.
0190	Pripoznanje v bilanci stanja		Uporabljajo se navodila za stolpec 0190 razpredelnice C 102.
0200	Status zavarovanja s premoženjem po MSRP 9	MSRP 9, B.5.55. člen	Uporabljajo se navodila za stolpec 0200 razpredelnice C 103.“.

PRILOGA II

„PRILOGA V

REFERENČNI INSTRUMENTI IN PORTFELJI ZA TRŽNO TVEGANJE

Oddelek 1: Navodila	18
Oddelek 2: Instrumenti	22
Oddelek 3: Posamezni portfelji – posamični instrument	36
Oddelek 4: Posamezni portfelji – več instrumentov	39
Oddelek 5: Združeni portfelji	42
Oddelek 6: Dodatne specifikacije za instrumente	43
Oddelek 7: Portfelji za validacijo SBM	45

Oddelek 1: Navodila

- (a) Za namene te priloge se uporablja naslednje:
- (i) ‚datum knjiženja‘ pomeni datum in uro, na katerega institucije knjižijo transakcije za namene postopka primerjanja;
 - (ii) ‚začetna ocena tržne vrednosti‘ pomeni tekočo tržno vrednost instrumentov iz oddelka 2 te priloge na referenčni datum in uro začetne ocene tržne vrednosti;
 - (iii) ‚referenčni datum začetne ocene tržne vrednosti‘ pomeni datum in uro, na katerega institucije določijo začetno oceno tržne vrednosti transakcij v portfelju za primerjanje;
 - (iv) ‚datum predložitve začetne ocene tržne vrednosti‘ pomeni datum, do katerega institucije predložijo rezultate glede začetne ocene tržne vrednosti transakcij v portfelju za primerjanje;
 - (v) ‚VaR‘ pomeni tvegano vrednost;
 - (vi) ‚sVaR‘ pomeni stresno tvegano vrednost;
 - (vii) ‚IRC‘ pomeni presežno tveganje neplačila in migracije;
 - (viii) ‚CTP‘ pomeni trgovalni portfelj s korelacijo;
 - (ix) ‚APR‘ pomeni vsa cenovna tveganja, izračunana v skladu s členom 377(2) Uredbe (EU) št. 575/2013;
 - (x) ‚mere tveganja‘ (RM) za banke z odobritvijo za uporabo notranjega modela (IMA), pomenijo vrednost VaR, sVaR in po potrebi IRC in APR za portfelje, kot je določeno v oddelkih 3 do 5 te priloge, med začetnim in končnim referenčnim datumom mer tveganja;
 - (xi) ‚začetni referenčni datum mer tveganja‘ pomeni datum, na katerega začnejo institucije izračunavati vrednosti mer tveganja;
 - (xii) ‚končni referenčni datum mer tveganja‘ pomeni datum, na katerega institucije nehajo izračunavati vrednosti mer tveganja;
 - (xiii) ‚datum predložitve mer tveganja‘ pomeni datum, do katerega institucije predložijo rezultate mer tveganja transakcij v portfelju za primerjanje;
 - (xiv) ‚sedanja vrednost‘ pomeni tekočo tržno vrednost portfeljev, določenih v oddelku 3 te priloge, na končni referenčni datum mer tveganja;
 - (xv) ‚ATM‘ pomeni ‚at the money‘ oziroma ‚enaka tržni‘ v smislu relativne pozicije trenutne ali prihodnje cene sredstva, ki je osnova, glede na izvršilno ceno tega izvedenega finančnega instrumenta;
 - (xvi) ‚OTM‘ pomeni ‚out of the money‘ oziroma ‚pod tržno‘ v smislu relativne pozicije trenutne ali prihodnje cene sredstva, ki je osnova, glede na izvršilno ceno tega izvedenega finančnega instrumenta;
 - (xvii) ‚ITM‘ pomeni ‚in the money‘ oziroma ‚nad tržno‘ v smislu relativne pozicije trenutne ali prihodnje cene sredstva, ki je osnova, glede na izvršilno ceno tega izvedenega finančnega instrumenta;
 - (xviii) ‚dolgo‘ pomeni ‚kupljeno‘ in ‚kratko‘ pomeni ‚prodano‘;
 - (xix) ‚CDS‘ pomeni posle kreditne zamenjave;
 - (xx) pri poslih kreditne zamenjave ‚dolgo‘ pomeni ‚kupljena zaščita‘, ‚kratko‘ pa ‚prodana zaščita‘;
 - (xxi) ‚mio.‘ pomeni milijon;
 - (xxii) ‚OTC‘ pomeni izven organiziranega trga vrednostnih papirjev;
 - (xxiii) ‚ASA‘ pomeni alternativni standardizirani pristop iz dela 3, naslov IV, poglavje 1a, oddelek 1, Uredbe (EU) št. 575/2013;
 - (xxiv) ‚SBM‘ pomeni metodo na podlagi občutljivosti iz dela 3, naslov IV, poglavje 1a, oddelek 2, Uredbe (EU) št. 575/2013;
 - (xxv) ‚DRC‘ pomeni zahtevo za tveganje neplačila iz dela 3, naslov IV, poglavje 1a, oddelek 5, Uredbe (EU) št. 575/2013.
 - (xxvi) ‚RRAO‘ pomeni pribitek za preostala tveganja iz dela 3, naslov IV, poglavje 1a, oddelek 4, Uredbe (EU) št. 575/2013.

- (b) Za postopek primerjanja se uporabljajo naslednji datumi:
- (i) datum knjiženja je 19. februar 2026;
 - (ii) referenčni datum začetne ocene tržne vrednosti (in začetka metode na podlagi občutljivosti) je 27. februar 2026 ob 17:30 CET);
 - (iii) datum predložitve začetne ocene tržne vrednosti (in datum predložitve začetka metode na podlagi občutljivosti ter validacije metode na podlagi občutljivosti) je 13. marec 2026;
 - (iv) začetni referenčni datum mer tveganja je 18. maj 2026;
 - (v) končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa) je 29. maj 2026;
 - (vi) datum predložitve mer tveganja (in končni datum predložitve alternativnega standardiziranega pristopa) je 26. junij 2026.
- (c) Če ni drugače navedeno v oddelku 2 te priloge, se vse pozicije knjižijo na datum knjiženja iz točke (b)(i) tega oddelka. Ko so pozicije knjižene, se vsak portfelj stara za trajanje postopka primerjanja in se izračuna pod predpostavko, da institucija v celotnem obdobju primerjanja ne stori ničesar, kar bi predstavljalo kakršno koli upravljanje portfelja. Če v specifikacijah za posamezen instrument ni izrecno navedeno drugače, se izvršilne cene za pozicije opcij določijo glede na cene instrumenta, ki je osnova, ob zaključku trgovanja na datum knjiženja.
- (d) Za namene začetne ocene tržne vrednosti se vrednost vsakega instrumenta predloži pristojnemu organu institucije do datuma predložitve začetne ocene tržne vrednosti. Do tega datuma institucija v skladu s točko (e) predloži pojasnjevalno opombo, ki je priložena rezultatom. Začetna ocena tržne vrednosti se predloži v skladu z vrednotenjem trgovalne enote institucije, kadar je možno. Če začetne ocene tržne vrednosti ne zagotovi trgovalna enota institucije, institucija v pojasnjevalni opombi navede, kdo je zagotovil vir podatkov za začetno oceno tržne vrednosti.
- (e) Pojasnjevalna opomba, ki jo institucije predložijo skupaj z začetno oceno tržne vrednosti, vključuje vse naslednje za vsak instrument:
- (i) dejavnike tveganja, uporabljene za izračun začetne ocene tržne vrednosti instrumenta;
 - (ii) model oblikovanja cen, uporabljen za izračun začetne ocene tržne vrednosti instrumenta, in opis tega modela oblikovanja cen;
 - (iii) razpoložljive referenčne podatke za instrument v lastnem formatu institucije;
 - (iv) vidike iz točk (h), (i), (l), (n), (o), (p), (w), (x), (z), in (hh) tega oddelka;
 - (v) institucije z odobritvijo za uporabo notranjih modelov, poročajo tudi:
 - (1) dejavnike tveganja, vključene v notranji model za instrument;
 - (2) dejavnike tveganja, vključene v notranji model, ki so tudi vhodni podatki vrednotenja za začetno oceno tržne vrednosti instrumenta;
 - (3) podrobnosti notranjega modela v zvezi z instrumenti.
- (f) Za namene točke (e)(v), se poroča vse naslednje:
- (i) natančni opisi notranjega modela;
 - (ii) uporabljene metode prevrednotenja;
 - (iii) funkcijska oblika, uporabljena za modeliranje dobičkov (npr. absolutna, relativna, druge metode);
 - (iv) kvalitativne informacije o časovni vrsti, uporabljeni za kalibracijo modela VaR glede na instrument (kot so vir, metodologija za normalizacijo, uporabljeni razredi, druge informacije, za katere institucije menijo, da so pomembne za pojasnilo predloženih rezultatov).
- (g) Pojasnjevalna opomba iz točke (d) se posodobi z vsako ponovno predložitvijo katere koli vrednosti, s čimer se odrazi sprememba med predloženimi vrednostmi. Pojasnjevalna opomba vsebuje oddelek, v katerem so navedeni vsi datumi predložitve in razlogi za ponovne predložitve.
- (h) Tveganje pozicij se izračuna brez upoštevanja stroškov financiranja. Kjer je primerno, institucije kot diskontno stopnjo uporabijo obrestno mero čez noč za valuto instrumenta. Šteje se, da je za izvedene finančne instrumente iz oddelka 2 te priloge sklenjen dogovor o zavarovanju s premoženjem. Kadar to ni možno, se v pojasnjevalni opombi iz točke (d) navedejo razlogi za to.

- (i) Kreditno tveganje nasprotne stranke in tveganje prilagoditve kreditnega vrednotenja se ne upoštevata pri vrednotenju tveganj portfeljev. Kadar to ni možno, se v pojasnjevalni opombi iz točke (d) tega oddelka navedejo razlogi za to. Institucije poročajo primere, ko so v začetno oceno tržne vrednosti vključene druge tipologije prilagoditev vrednotenja, ter za vsak finančni instrument pojasnijo metodologijo in vpliv v pojasnjevalni opombi iz točke (d) tega oddelka.
- (j) Za transakcije, ki vključujejo dolge pozicije v CDS, institucije predpostavljajo, da se plača takojšnja vnaprejšnja provizija za odprtje pozicije, skladno s tržnimi standardi in ustaljenimi praksami. Datumi dospelosti za vse CDS so enaki običajnim četrtnim datumom zaključka pogodb.
- (k) Dodatne specifikacije, potrebne za izračun cen, ki se zahtevajo za pozicije v CDS, so skladne z običajnimi tržnimi standardi in ustaljenimi praksami ter se pojasnijo v pojasnjevalni opombi iz točke (d) tega oddelka.
- (l) Datum dospelosti zagotavlja, da je transakcija najbližje navedenemu času do dospelosti, določenem v skladu s tržnimi standardi in ustaljenimi praksami.
- (m) V zvezi s podrobnostmi o instrumentih, ki niso navedeni v oddelku 2 te priloge, institucije navedejo predpostavke, ki so bile uporabljene, vključno z dogovorom o številu dni in izborom likvidnega instrumenta, s katerim se trguje, kadar je to dovoljeno, skupaj z rezultati v pojasnjevalni opombi iz točke (d) tega oddelka.
- (n) Institucije, ki menijo, da so poleg predpostavk iz tega oddelka za razlago rezultatov postopka pomembne tudi druge predpostavke, vključno s časom zaključka poslovanja, prilagoditvijo števila dni za kupone, vzporejanjem z indeksi in drugimi, predložijo opis teh predpostavk v pojasnjevalni opombi iz točke (d) tega oddelka.
- (o) Pojasnjevalna opomba iz točke (d) tega oddelka vključuje razlage za tveganja, ki niso zajeta v modelu za instrumente iz oddelka 2 te priloge.
- (p) Vse opcije se obravnavajo, kot da se z njimi trguje izven organiziranega trga vrednostnih papirjev (OTC), razen če je navedeno drugače.
- (q) Upoštevajo se standardni dogovori o časovnih okvirih za opcije OTC. Čas do dospelosti za n-mesečno opcijo je n mesecev. Kadar se opcija izteče na dan, ki ni trgovni dan, institucije datum izteka opcije prilagodijo na naslednji delovni dan v skladu z običajnimi tržnimi standardi in ustaljenimi praksami.
- (r) Vse opcije OTC se obravnavajo kot:
 - (i) ameriške v primeru lastniških finančnih instrumentov za eno samo izpostavljenost in blaga;
 - (ii) evropske za delniške indekse, valutne opcije in opcije na zamenjavo obrestnih mer.
- (s) Vse opcije OTC se obravnavajo kot „nekrite“, tako da se premija izključi iz začetnega tržnega vrednotenja.
- (t) V zvezi s CTP institucije, ki jim je dovoljeno uporabljati model APR za CTP, zagotovijo podatke o svojih najpomembnejših predpostavkah ter tržnih standardih in ustaljenih praksah v zvezi z instrumentoma CTP iz oddelka 2 te priloge, vključno s količniki varovanja pred tveganjem, ki so jih izračunale, da bi bili instrumenti CTP CS01 nevtralni na datum knjiženja.
- (u) Začetna ocena tržne vrednosti za vsak instrument se navede v valuti instrumenta EBA, določeni v oddelku 2 te priloge za navedeni instrument.
- (v) Za portfelje, sestavljene iz enega ali več instrumentov, denominiranih v valutah instrumentov EBA, ki se razlikujejo od valute portfelja EBA, se rezultat pretvori v valuto portfelja EBA, v kateri se poroča, z uporabo promptnega menjalnega tečaja ECB na zadevni datum. Preračunani rezultat se pojasni v pojasnjevalni opombi iz točke (d) tega oddelka.
- (w) Pri knjiženju pozicij institucije upoštevajo ustrezne tržne ustaljene prakse, razen če je v teh navodilih v opisih instrumentov (oddelek 2 te priloge) določeno drugače.

- (x) Če se za instrument ali instrument, ki je osnova za izvedeni finančni instrument, uporabi korporacijsko dejanje, ki vpliva na ta postopek primerjanja, kot je odpoklic s strani izdajatelja, neplačilo ipd., institucije tak instrument izključijo iz portfelja skupaj z vsemi povezanimi CDS ali opcijami.
- (y) Pri serijah indeksov se ‚aktualnost‘ nanaša na najbolj likvidno serijo tega indeksa, s katero se trguje, ki je na voljo na trgu. Institucije svojo izbiro ‚aktualne‘ serije skupaj s povezanimi rezultati pojasnijo v priloženi pojasnjevalni opombi iz točke (d) tega oddelka.
- (z) Če ni določeno drugače, institucije za določitev obrestne mere pri knjiženju instrumentov, določenih v oddelku 2 te priloge, uporabijo uredbo EU o referenčnih vrednostih. Institucije uporabljeno obrestno mero, ki ni ena od tistih, navedenih v oddelku 2 te priloge, navedejo v pojasnjevalni opombi iz točke (d) teh navodil.
- (aa) Mere tveganja za portfelje iz oddelkov 3 do 5 te priloge se skupaj s sedanjo vrednostjo izračunajo od ‚začetnega referenčnega datuma mer tveganja‘ do ‚končnega referenčnega datuma mer tveganja‘. Mere tveganja (SBM, DRC in RRAO) po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige se izračunajo za ‚končni referenčni datum mer tveganja‘. Institucije rezultate teh izračunov predložijo svojemu pristojnemu organu do datuma predložitve mer tveganja. Začetna ocena tržne vrednosti in metoda na podlagi občutljivosti se poročata za vsak instrument. Mere tveganja, metoda na podlagi občutljivosti, zahteve za tveganje neplačila, pribitek za preostala tveganja in sedanja vrednost se, kadar je primerno, poročajo za vsak portfelj, in sicer posamično in združeno. Metoda na podlagi občutljivosti, zahteve za tveganje neplačila in pribitek za preostala tveganja se, kadar je primerno, poročajo vsaj za iste portfelje, za katere se poročajo mere tveganja.
- (bb) Institucije za portfelje iz oddelka 7 te priloge poročajo rezultate metode na podlagi občutljivosti in jih predložijo v skladu z datumi poročanja za predložitev začetne ocene tržne vrednosti.
- (cc) Institucije, ki spadajo na področje uporabe postopka primerjanja, poročajo samo instrumente na podlagi notranjih modelov, za katere so prejele odobritev nadzornikov in s katerimi jim trgovanja ne prepoveduje notranja odločitev politike ali omejitve sistema trgovanja.
- (dd) Rezultati za posamezne in združene portfelje se predložijo samo, kadar se predložijo tudi rezultati vseh instrumentov, ki so tudi del teh portfeljev.
- (ee) V oddelku 2 te priloge (Instrumenti) ‚leto T‘ pomeni ‚2026‘, leto T+X pa leto 2026+X, pri čemer je X določen v oddelku 2.
- (ff) V oddelku 2 te priloge (Instrumenti) institucije določijo dan izteka/dospelosti v skladu z naslednjimi navodili:
 - (i) kadar je datum določen, se uporabi točno ta datum;
 - (ii) kadar datum ni določen, se uporabi ustaljena tržna praksa, kadar obstaja. Če na primer obstaja ustaljena tržna praksa, da je dan izteka/dospelosti tretji petek v mesecu, potem ‚junij leta T‘ pomeni tretji petek v mesecu leta T;
 - (iii) konec meseca, kadar je navedeno ‚konec‘, pomeni zadnji koledarski dan v mesecu;
 - (iv) za določeno obdobje, ki sledi ‚datumu knjiženja‘, če je obdobje opredeljeno kot število dni, je to zadnji dan obdobja. Če je obdobje določeno v tednih, mesecih ali letih, je to isti dan naslednjega tedna, meseca ali leta glede na datum knjiženja ali, če je zadnji mesec ali leto obdobja krajše, zadnji dan tega meseca ali leta; če je ‚datum knjiženja + x obdobje‘ praznik, izberite naslednji delovni dan;
 - (v) če ni določeno drugače, se uporabijo naslednje predpostavke: dogovor o štetju dni: dejansko/360, koledar počitnic: Target2.
- (gg) V oddelku 2 te priloge (Instrumenti) se za vse CDS, razen če je izrecno določeno drugače, uporabljajo naslednje zahteve:
 - (i) izplačevanje kupona: četrtno;
 - (ii) kupon (bazične točke): 100;
 - (iii) štetje dni: dejansko/360;
 - (iv) leto opredelitev ISDA: 2014;
 - (v) klavzula o prestrukturiranju: prilagojeno prilagojeno prestrukturiranje (*Modified-Modified Restructuring – MMR*);
 - (vi) dospelost: december leta T+4;

- (vii) vrsta dolga: nadrejeni;
 - (viii) trajanje: 5 let;
 - (ix) datum začetka veljavnosti je datum knjiženja;
 - (x) uporabljena krivulja diskontiranja in stopnja izterjave se pojasnita v pojasnjevalni opombi iz točke (d) te priloge.
- (hh) Začetna tržna vrednost instrumentov obveznic vključuje obračunane obresti.
- (ii) Institucije zagotovijo informacije v zvezi s časom ocene sedanje vrednosti z navedbo časa v pojasnjevalni opombi iz točke (e) tega oddelka. Kjer je mogoče, se ocena sedanje vrednosti izračuna ob koncu delovnega dne.
- (jj) Mere tveganja portfeljev se izračunajo v isti valuti, kot je valuta portfelja, brez upoštevanja valutnega tveganja, prav tako povezanega z valuto poročanja institucij. Valutno tveganje se upošteva samo, kadar je neločljivo vključeno v instrumente. Kadar se rezultati v valuti poročanja in valuti portfelja poročajo kot del postopka, se za vrednosti alternativnega standardnega pristopa rezultati, izračunani v valuti poročanja institucije, pretvorijo v valuto portfelja EBA po promptnem menjalnem tečaju ECB, povezanim z datumom izračuna. Pretvorba v valuto portfelja EBA ne pomeni spremembe dejavnikov valutnega tveganja.
- (kk) Kadar se uporablja člen 325q(7) Uredbe (EU) št. 575/2013 (v nadaljnjem besedilu: pristop osnovne valute), institucije pri izračunih po metodi na podlagi občutljivosti in poročanju občutljivosti na te metode upoštevajo dejavnike valutnega tveganja, ki izhajajo iz uporabe pristopa osnovne valute. Poročane vrednosti se ne izrazijo v izbrani osnovni valuti, temveč v valuti poročanja institucij, pri čemer se pretvorijo po promptnem menjalnem tečaju ECB, povezanim z zadevnim datumom.

Oddelek 2: Instrumenti

Institucije v skladu z navodili iz oddelka 1 te priloge navedejo začetno oceno tržne vrednosti za naslednje finančne instrumente, za katere institucije navedejo mere tveganja in sedanjo vrednost portfeljev iz oddelka 3 in oddelka 4:

LASTNIŠKI INSTRUMENTI

101. Dolga pozicija v standardiziranih terminskih pogodbah na indeks EURO STOXX 50 (trgovalna koda: FESX)
- Nominalni znesek: enakovreden vrednosti indeksa, pomnoženi s 1 000 EUR
- Borza: Eurex
- Datum izteka: september leta T
- Valuta instrumenta EBA: EUR
102. Dolga pozicija v 10 000 delnicah BAYER (trgovalna koda BAYN GR)
- Borza: Xetra
- Valuta instrumenta EBA: EUR
103. Kratka pozicija v standardiziranih terminskih pogodbah na BAYER (trgovalna koda: BAYN GR)
- Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
- Borza: Eurex
- Datum izteka: september leta T
- Valuta instrumenta EBA: EUR
104. Kratka pozicija v standardiziranih terminskih pogodbah na STELLANTIS (trgovalna koda: STLA FP)
- Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
- Borza: Euronext
- Datum izteka: september leta T
- Valuta instrumenta EBA: EUR

105. Kratka pozicija v standardiziranih terminskih pogodbah na ALLIANZ (trgovalna koda: ALV GR)
Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
Borza: Eurex
Datum izteka: september leta T
Valuta instrumenta EBA: EUR
106. Kratka pozicija v standardiziranih terminskih pogodbah na BARCLAYS (trgovalna koda: BARC LN)
Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
Borza: Eurex
Datum izteka: september leta T
Valuta instrumenta EBA: GBP
107. Kratka pozicija v standardiziranih terminskih pogodbah na DEUTSCHE BANK (trgovalna koda: DBK GR)
Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
Borza: Eurex
Datum izteka: september leta T
Valuta instrumenta EBA: EUR
108. Kratka pozicija v standardiziranih terminskih pogodbah na CRÉDIT AGRICOLE (trgovalna koda: ACA FP)
Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
Borza: Euronext
Datum izteka: september leta T
Valuta instrumenta EBA: EUR
109. Dolge nakupne opcije. Osnova BAYER (trgovalna koda: BAYN GR), ATM (1 pogodba = 100 delnic)
Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
Datum izteka: september leta T
Valuta instrumenta EBA: EUR
110. Kratke nakupne opcije. Osnova BAYER (trgovalna koda: BAYN GR), ATM (1 pogodba = 100 delnic)
Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
Datum izteka: december leta T
Valuta instrumenta EBA: EUR
111. Dolge nakupne opcije. Osnova PFIZER (trgovalna koda: PFE US), 10 % OTM (1 pogodba = 100 delnic)
Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
Datum izteka: september leta T
Valuta instrumenta EBA: USD
112. Dolge prodajne opcije. Osnova PFIZER (trgovalna koda: PFE US), 10 % OTM (1 pogodba = 100 delnic).
Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
Datum izteka: september leta T
Valuta instrumenta EBA: USD

113. Dolge nakupne opcije. Osnova BAYER (trgovalna koda: BAYN GR), 10 % OTM (1 pogodba = 100 delnic)
 Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
 Datum izteka: december leta T
 Valuta instrumenta EBA: EUR
114. Kratke nakupne opcije. Osnova BAYER (trgovalna koda: BAYN GR), 10 % OTM (1 pogodba = 100 delnic)
 Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
 Datum izteka: september leta T
 Valuta instrumenta EBA: EUR
115. Dolge nakupne opcije. Osnova AVIVA (trgovalna koda: AV/LN), 10 % OTM (1 pogodba = 100 delnic)
 Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
 Datum izteka: december leta T
 Valuta instrumenta EBA: GBP
116. Dolge prodajne opcije. Osnova AVIVA (trgovalna koda: AV/LN), 10 % OTM (1 pogodba = 100 delnic)
 Nominalni znesek: enakovreden vrednosti 10 000 delnic sredstva, ki je osnova
 Datum izteka: december leta T
 Valuta instrumenta EBA: GBP
117. Kratka pozicija v standardiziranih terminskih pogodbah na NIKKEI 225 (trgovalna koda: NKY)
 Nominalni znesek: enakovreden vrednosti indeksa, pomnoženi s 20 000 JPY
 Borza: CME
 Datum izteka: september leta T
 Valuta instrumenta EBA: JPY
118. Lastniški instrument s samodejnim odpoklicem
 Dolga pozicija
 Knjiženje na ‚datum knjiženja‘
 Nominalni znesek (‚kapital‘): 1 000 000 EUR
 Osnova: indeks EURO STOXX 50 (trgovalna koda: SX5E)
 Valuta instrumenta EBA: EUR
 Dospelost: 5 let
 Letno plačilo in letno spremljanje (‚datum knjiženja + 1 leto‘, ‚datum knjiženja + 2 leti‘, ‚datum knjiženja + 3 leta‘, ‚datum knjiženja + 4 leta‘, ‚datum knjiženja + 5 let‘). Do izplačila pride 10 dni po referenčnem datumu.
 Kupon: 6 %
 Raven samodejnega odpoklica (‚začetna vrednost‘): konec dneva na datum knjiženja + 1 mesec
 Plačilo kupona ob meji 60 % ravni samodejnega odpoklica
 Varovalna meja: 55 % ravni samodejnega odpoklica
- Kapital ni garantiran, če je indeks pod varovalno mejo (vrnjeni kapital v 5. letu bo sorazmeren, če je raven pod varovalno mejo: na primer, če je SX5E = 40 % začetne ravni, se vrne 40 % kapitala);
 - če je $SX5E \geq 60\%$ (kupon ob meji) začetne vrednosti ob koncu katerega koli leta, se izplača kupon v višini 6 %;

- če je $SX5E \geq 100\%$ začetne vrednosti ob koncu katerega koli leta, se produkt odpokliče ter se izplačata kupon in kapital (100 %);
- če je $SX5E < 60\%$ (kupon ob meji) začetne vrednosti ob koncu katerega koli leta, se kupon ne izplača;
- če je $SX5E < 55\%$ (varovalna meja) začetne vrednosti ob koncu 5. leta, se kapital izplača samo sorazmerno; če je $SX5E \geq 55\%$ (varovalna meja) začetne vrednosti ob koncu 5. leta, se kapital izplača v celoti.

119. Dolge nakupne opcije. Osnova indeks EURO STOXX 50 (trgovalna koda: SX5E), ATM

Nominalni znesek: enakovreden vrednosti indeksa, pomnoženi s 1 000 EUR

Datum izteka: september leta T

Valuta instrumenta EBA: EUR

120. Dolge nakupne opcije. Osnova indeks EURO STOXX 600 (trgovalna koda: SXXP), ATM

Nominalni znesek: enakovreden vrednosti indeksa, pomnoženi s 10 000 EUR

Datum izteka: september leta T

Valuta instrumenta EBA: EUR

121. Dolga pozicija v standardiziranih terminskih pogodbah na indeks VIX (CBOE)

Nominalni znesek: enakovreden vrednosti indeksa, pomnoženi s 100 000 USD

Datum izteka: september leta T

Valuta instrumenta EBA: USD

OBRETNOSTNA MERA

201. Petletna zamenjava obrestnih mer EUR – prejem fiksne obrestne mere in plačilo spremenljive obrestne mere

Stran s fiksno obrestno mero: letni prejem

Spremenljiva obrestna mera: šestmesečni EURIBOR, polletno plačilo štetje dni: dejansko/360

Nominalni znesek 10 000 000 EUR

Prilagoditev in koledar štetja dni za nedelovne dneve: standardna

Datum začetka veljavnosti je datum knjiženja (tj. obrestne mere, ki se uporabijo, so obrestne mere ob zaključku trgovanja na datum knjiženja)

Dospelost: datum knjiženja + 5 let

Valuta instrumenta EBA: EUR

202. Dveletna opcija na zamenjavo obrestnih mer EUR na petletno zamenjavo obrestnih mer EUR – plačilo fiksne obrestne mere in prejem spremenljive obrestne mere

Nominalni znesek: 10 000 000 EUR

Institucija je prodajalec opcije na zamenjavo. Nasprotna stranka institucije kupi pravico do sklenitve zamenjave z institucijo; če nasprotna stranka izkoristi svojo pravico, prejme fiksno obrestno mero, institucija pa prejme spremenljivo obrestno mero.

Opcija na zamenjavo obrestnih mer z dospelostjo dve leti (datum knjiženja + 2 leti) na zamenjavo obrestnih mer, opredeljeno, kot sledi: Stran s fiksno obrestno mero: letno plačilo. Spremenljiva obrestna mera: šestmesečni EURIBOR, polletni prejem. Nominalni znesek: 10 000 000 EUR. Prilagoditev in koledar štetja dni za nedelovne dneve: standardna. Datum začetka veljavnosti zamenjave, ki je osnova: datum knjiženja + 2 leti

Dospelost zamenjave, ki je osnova: datum knjiženja + 7 let

Premija plačana na datum knjiženja (datum knjiženja). Poravnana z denarnimi sredstvi.

Izvršilna cena temelji na tečaju ATM terminske zamenjave, določene v tem instrumentu.

Valuta instrumenta EBA: EUR

203. Petletna zamenjava obrestnih mer USD. Prejem fiksne obrestne mere in plačilo spremenljive obrestne mere.

Fiksna obrestna mera: letni prejem

Spremenljiva obrestna mera: trimesečna referenčna mera SOFR za USD (čeznočna SOFR, konformna dnevna), četrtletno plačilo

Nominalni znesek: 1 000 000 USD

Prilagoditev in koledar štetja dni za nedelovne dneve: standardna

Datum začetka veljavnosti je datum knjiženja (tj. obrestne mere, ki se uporabijo, so obrestne mere ob zaključku trgovanja na datum knjiženja)

Datum dospelosti: datum knjiženja + 5 let

Valuta instrumenta EBA: USD

204. Dveletna zamenjava obrestnih mer GBP. Prejem fiksne obrestne mere in plačilo spremenljive obrestne mere.

Fiksna obrestna mera: letni prejem

Spremenljiva obrestna mera: obrestna mera SONIA (čez noč), konformna in četrtletno plačilo. Štetje dni: dejansko/365

Nominalni znesek: 10 000 000 GBP

Prilagoditev in koledar štetja dni za nedelovne dneve: standardna

Datum začetka veljavnosti je datum knjiženja (tj. obrestne mere, ki se uporabijo, so obrestne mere ob zaključku trgovanja na datum knjiženja)

Dospelost: datum knjiženja + 2 leti

Valuta instrumenta EBA: GBP

205. 10-letna obveznica s spremenljivo obrestno mero in ovratnico, ki jo je prodala UBS

Nominalni znesek (glavnica): 1 000 000 USD

Obveznice s spremenljivo obrestno mero (obveznice) so nadrejene nezavarovane obveznosti družbe UBS AG (UBS)

Valuta instrumenta EBA: USD

- Obveznice bodo prinašale obresti po letni obrestni meri, ki je enaka trimesečni referenčni meri SOFR za USD (čeznočna SOFR, konformna dnevna) plus 1,5 % letno (spremenljiva obrestna mera), pri čemer obrestna mera znaša največ 7,5 % na leto (obrestna kapica) in najmanj 2,5 % na leto (obrestno dno);
- vsako izplačilo na obveznice, vključno z obrestmi in glavnico ob dospelosti, je odvisno od kreditne sposobnosti UBS AG. Od institucij se zahteva, da uporabijo ustrezno krivuljo diskontiranja, kar pojasnijo v pojasnjevalni opombi;
- dohodek: za obveznice se bodo četrtletno izplačevale obresti po obrestni meri, ki je enaka spremenljivi obrestni meri, in sicer, če je na datum določitve kupona: (i) spremenljiva obrestna mera nižja od obrestnega dna, je veljavna obrestna mera za zadevno obrestno obdobje enaka obrestnemu dnu, ali če je (ii) spremenljiva obrestna mera višja od obrestne kapice, je veljavna obrestna mera za zadevno obrestno obdobje enaka obrestni kapici.

Znesek plačila obresti: znesek obresti, ki se plačajo na obveznice za obrestno obdobje, je enak zmnožku (a) zneska glavnice obveznic, (b) veljavne obrestne mere za to obrestno obdobje in (c) ulomka, ki ima v števcu število dni obrestnega obdobja (izračunano na podlagi 360-dnevnega leta z dvanajstimi 30-dnevnimi meseci) in v imenovalcu pa 360

Datum sklenitve posla in datum poravnave:	„datum knjiženja“
Datum plačila obresti:	četrtno, na datum knjiženja + 3 mesece, datum knjiženja + 6 mesecev, datum knjiženja + 9 mesecev in datum knjiženja + 1 leto, ki se začne na datum knjiženja + 3 mesece, v času trajanja obveznic (ob upoštevanju prilagoditev v njih opisanih prilagoditev)
Datum dospelosti:	datum knjiženja + 10 let
Valuta	USD
osnova za štetje dni:	30/360
Dogovor o delovnih dneh:	naslednji delovni dan, neprilagojeno
Datum določitve kupona	za vsako obrestno obdobje drugi londonski bančni dan, ki je neposredno pred zadevnim datumom plačila obresti „Londonski bančni dan“ pomeni dan, na katerega so poslovne banke odprte za splošno poslovanje (vključno s poslovanjem v tujih valutah in z vlogami v tujih valutah) v Londonu in na katerega se posli v ameriških dolarjih sklepajo na londonskem medbančnem trgu.

206. Dolga pozicija v nemških državnih obveznicah (inflacija) v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030583)
Dospelost: 15. april 2033
Valuta instrumenta EBA: EUR
207. Kratka pozicija v nemških državnih obveznicah v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030708)
Dospelost: 15. avgust 2030
Valuta instrumenta EBA: EUR
208. Dolga pozicija v italijanskih državnih obveznicah (inflacija) v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN IT0005138828)
Dospelost: 15. september 2032
Valuta instrumenta EBA: EUR
209. Dolga pozicija v italijanskih državnih obveznicah v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN IT0005340929)
Dospelost: 1. december 2028
Valuta instrumenta EBA: EUR
210. Dolga pozicija v španskih državnih obveznicah v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN ES00000127A2)
Dospelost: 30. julij 2030
Valuta instrumenta EBA: EUR
211. Kratka pozicija v francoskih državnih obveznicah v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN FR0012993103)
Dospelost: 25. maj 2031
Valuta instrumenta EBA: EUR
212. Kratka pozicija v nemških državnih obveznicah v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN DE0001135176)
Dospelost: 4. januar 2031
Valuta instrumenta EBA: EUR
213. Dolga pozicija v državnih obveznicah Združenega kraljestva v vrednosti 1 000 000 GBP (ISIN GB0004893086)
Dospelost: 7. junij 2032
Valuta instrumenta EBA: GBP

214. Dolga pozicija v portugalskih državnih obveznicah v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN PTOTEXOE0024)
Dospelost: 15. junij 2029
Valuta instrumenta EBA: EUR
215. Kratka pozicija v državnih obveznicah Združenih držav v vrednosti 1 000 000 USD (ISIN US91282CAV37)
Dospelost: 15. november 2030
Valuta instrumenta EBA: USD
216. Dolga pozicija v brazilskih državnih obveznicah (z možnostjo odpoklica) v vrednosti 1 000 000 USD (ISIN US105756BZ27)
Dospelost: 13. januar 2028
Valuta instrumenta EBA: USD
217. Dolga pozicija v mehiških državnih obveznicah (z možnostjo odpoklica) v vrednosti 1 000 000 USD (ISIN US91087BAT70)
Dospelost: 19. maj 2033
Valuta instrumenta EBA: USD
218. Desetletna zamenjava obrestnih mer EURO – prejem spremenljive obrestne mere in plačilo fiksne obrestne mere
Stran s fiksno obrestno mero: letno plačilo
Spremenljiva obrestna mera: trimesečni EURIBOR, četrtletni prejem Štetje dni: dejansko/360
Nominalni znesek: 10 000 000 EUR
Prilagoditev in koledar štetja dni za nedelovne dneve: standardna
Datum začetka veljavnosti je datum knjiženja (tj. obrestne mere, ki se uporabijo, so obrestne mere ob zaključku trgovanja na datum knjiženja)
Dospelost: datum knjiženja + 10 let
Valuta instrumenta EBA: EUR
219. Petletna zamenjava obrestnih mer EURO – prejem spremenljive obrestne mere in plačilo fiksne obrestne mere
Stran s fiksno obrestno mero: letno plačilo
Spremenljiva obrestna mera: šestmesečni EURIBOR, prejem vsakih 6 mesecev Štetje dni: dejansko/360
Nominalni znesek: 10 000 000 EUR
Prilagoditev in koledar štetja dni za nedelovne dneve: standardna
Datum začetka veljavnosti je datum knjiženja (tj. obrestne mere, ki se uporabijo, so obrestne mere ob zaključku trgovanja na datum knjiženja)
Dospelost: datum knjiženja + 5 let
Valuta instrumenta EBA: EUR
220. Petletna medvalutna zamenjava EUR/USD po trenutni tržni ceni. Prejem USD in plačilo EUR
EUR: trimesečna referenčna mera ESTER, četrtletno plačilo, konformna, z dvodnevним odlogom pri poravnavi. Štetje dni: dejansko/360
USD: trimesečna referenčna mera SOFR (čeznočna SOFR, konformni dnevni), četrtletni prejem, konformna, z dvodnevним odlogom pri poravnavi. Štetje dni: dejansko/360
Stran posla 1 – USD: nominalni znesek enakovreden 10 000 000 EUR, četrtletna prilagoditev
Stran posla 2 – EUR: nominalni znesek 10 000 000 EUR
Prilagoditev in koledar štetja dni za nedelovne dneve: standardna
Datum začetka veljavnosti je datum knjiženja + 6 mesecev
Dospelost: datum knjiženja + 5,5 let
Valuta instrumenta EBA: EUR
Glej tudi oddelek 6 te priloge – Dodatne specifikacije instrumenta

221. Desetletna zamenjava obrestnih mer EURO – prejem ESTER in plačilo EURIBOR
- Stran posla z ESTER: letni prejem. Štetje dni: dejansko/360
- Stran posla z EURIBOR: trimesečni EURIBOR + osnova, četrletno plačilo. Štetje dni: dejansko/360
- Nominalni znesek: 10 000 000 EUR
- Prilagoditev in koledar štetja dni za nedelovne dneve: standardna
- Datum začetka veljavnosti je datum knjiženja (tj. obrestne mere, ki se uporabijo, so obrestne mere ob zaključku trgovanja na datum knjiženja)
- Dospelost: datum knjiženja + 10 let
- Valuta instrumenta EBA: EUR
222. Dolga pozicija v italijanskih državnih obveznicah (inflacija) v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN IT0005387052)
- Dospelost: 15. maj 2030
- Valuta instrumenta EBA: EUR
223. Petletna brezakuponska zamenjava inflacije EUR – prejem donosa, indeksiranega z inflacijo, in plačilo fiksne obrestne mere (r)
- Indeks inflacije: CPI (HICPxT)
- Stran posla s fiksno mero (plačilo fiksne obrestne mere): $[(1 + r)^5 - 1]$
- Prejem donosa, indeksiranega z inflacijo : $\left[\left(\frac{CPI \text{ na končni datum (dospelost)}}{CPI \text{ na datum začetka}} \right) - 1 \right]$
- Nominalni znesek 10 000 000 EUR
- Datum določitve osnove: datum knjiženja – 3 meseci
- Končna določitev: datum knjiženja + 4 let 9 mesecev
- Dospelost: datum knjiženja + 5 let
- Valuta instrumenta EBA: EUR
224. Dveletna opcija na zamenjavo obrestnih mer EUR na petletno zamenjavo obrestnih mer EUR – prejem fiksne obrestne mere in plačilo spremenljive obrestne mere
- Nominalni znesek: 10 000 000 EUR
- Institucija je prodajalec opcije na zamenjavo. Nasprotna stranka institucije kupi pravico do sklenitve zamenjave z institucijo; če nasprotna stranka izkoristi svojo pravico, prejme spremenljivo obrestno mero, institucija pa prejme fiksno obrestno mero.
- Opcija na zamenjavo obrestnih mer z dospelostjo dve leti (datum knjiženja + 2 leti) na zamenjavo obrestnih mer, opredeljeno, kot sledi: stran s fiksno obrestno mero – letni prejem; spremenljiva obrestna mera: šestmesečni EURIBOR, plačilo vsakih 6 mesecev. Nominalni znesek: 10 000 000 EUR. Prilagoditev in koledar štetja dni za nedelovne dneve: standardna. Datum začetka veljavnosti zamenjave, ki je osnova: datum knjiženja + 2 leti
- Dospelost zamenjave, ki je osnova: datum knjiženja + 7 let
- Premija plačana na datum knjiženja (datum knjiženja). Poravnana z denarnimi sredstvi.
- Izvršilna cena temelji na tečaju ATM terminske zamenjave, določene v tem instrumentu, h kateremu se prišteje 100 bazičnih točk.
- Valuta instrumenta EBA: EUR

VALUTA

301. Šestmesečna nestandardizirana terminska pogodba USD/EUR. Poravnana z denarnimi sredstvi. Dolga pozicija v USD – kratka pozicija v EUR; nominalni znesek 10 000 000 USD; izvršilna cena terminske pogodbe: enaka 100 % zadevnega promptnega referenčnega tečaja ECB ob koncu dneva knjiženja.
- Valuta instrumenta EBA: EUR

302. Šestmesečna nestandardizirana termimska pogodba EUR/GBP. Poravnana z denarnimi sredstvi. Dolga pozicija v EUR – kratka pozicija v GBP; nominalni znesek 10 000 000 GBP; izvršilna cena termimske pogodbe: enaka 100 % zadevnega promptnega referenčnega tečaja ECB ob koncu dneva knjiženja.
- Valuta instrumenta EBA: EUR
303. Dolga pozicija v denarnih sredstvih v višini 10 000 000 USD
- Denarna pozicija. Šteje se, da ima intrinzično valutno tveganje, kot je opisano v odstavku (kk).
- Valuta instrumenta EBA: EUR
304. Dolga nakupna opcija EUR/USD (dolga pozicija v EUR, kratka pozicija v USD). Poravnana z denarnimi sredstvi. Nominalni znesek: 10 000 000 EUR. Enakovreden znesek na podlagi referenčnega promptnega tečaja ECB za EUR/USD ob koncu dneva knjiženja.
- Izvršilna cena: 110 % referenčnega tečaja ECB za EUR/USD ob koncu dneva knjiženja
- Datum izteka: datum knjiženja + 1 leto
- Valuta instrumenta EBA: EUR
305. Dolga nakupna opcija EUR/USD (dolga pozicija v EUR, kratka pozicija v USD). Poravnana z denarnimi sredstvi. Nominalni znesek: 10 000 000 EUR. Enakovreden znesek na podlagi referenčnega promptnega tečaja ECB za EUR/USD ob koncu dneva knjiženja.
- Izvršilna cena: 90 % referenčnega tečaja ECB za EUR/USD ob koncu dneva knjiženja
- Datum izteka: datum knjiženja + 1 leto
- Valuta instrumenta EBA: EUR
306. Kratka nakupna opcija EUR/USD (kratka pozicija v EUR, dolga pozicija v USD). Poravnana z denarnimi sredstvi. Nominalni znesek: 10 000 000 EUR. Enakovreden znesek na podlagi referenčnega promptnega tečaja ECB za EUR/USD ob koncu dneva knjiženja.
- Izvršilna cena: 100 % referenčnega tečaja ECB za EUR/USD ob koncu dneva knjiženja
- Datum izteka: datum knjiženja + 1 leto
- Valuta instrumenta EBA: EUR
307. Kratka nakupna opcija EUR/GBP (kratka pozicija v EUR, dolga pozicija v GBP). Poravnana z denarnimi sredstvi. Nominalni znesek: 10 000 000 EUR. Enakovreden znesek na podlagi referenčnega promptnega tečaja ECB za EUR/GBP ob koncu dneva knjiženja.
- Izvršilna cena: 110 % referenčnega tečaja ECB za EUR/GBP ob koncu dneva knjiženja
- Datum izteka: datum knjiženja + 1 leto
- Valuta instrumenta EBA: EUR
308. Dolga prodajna opcija EUR/JPY (kratka pozicija v EUR, dolga pozicija v JPY). Poravnana z denarnimi sredstvi. Nominalni znesek: 10 000 000 EUR. Enakovreden znesek na podlagi referenčnega promptnega tečaja ECB za EUR/JPY ob koncu dneva knjiženja.
- Izvršilna cena: 110 % referenčnega tečaja ECB za EUR/JPY ob koncu dneva knjiženja
- Datum izteka: datum knjiženja + 1 leto
- Valuta instrumenta EBA: EUR
309. Kratka prodajna opcija EUR/AUD (dolga pozicija v EUR, kratka pozicija v AUD). Poravnana z denarnimi sredstvi. Nominalni znesek: 10 000 000 EUR. Enakovreden znesek na podlagi referenčnega promptnega tečaja ECB za EUR/AUD ob koncu dneva knjiženja.
- Izvršilna cena: 110 % referenčnega tečaja ECB za EUR/AUD ob koncu dneva knjiženja
- Datum izteka: datum knjiženja + 1 leto
- Valuta instrumenta EBA: EUR

310. Šestmesečna nestandardizirana termimska pogodba EUR/DKK (dolga pozicija v EUR, kratka pozicija v DKK). Poravnana z denarnimi sredstvi. Nominalni znesek 10 000 000 EUR;

izvršilna cena termimske pogodbe: enaka 100 % zadevnega promptnega referenčnega tečaja ECB za EUR/DKK ob koncu dneva knjiženja.

Valuta instrumenta EBA: EUR

311. Šestmesečna nestandardizirana termimska pogodba EUR/BRL brez dejanske poravnave (dolga pozicija v EUR, kratka pozicija v BRL). Nominalni znesek 10 000 000 EUR;

izvršilna cena termimske pogodbe: enaka 100 % zadevnega promptnega referenčnega tečaja ECB za EUR/BRL ob koncu dneva knjiženja.

Valuta instrumenta EBA: EUR

BLAGO

401. Dolga pozicija v šestmesečnih nestandardiziranih termimskih pogodbah na 3 500 trojanskih unč zlata na londonskem trgu (dolga pozicija v zlatu, kratka pozicija v USD). Poravnana z denarnimi sredstvi. Izvršilna cena: šestmesečna termimska cena ob koncu dneva na datum knjiženja

Valuta instrumenta EBA: USD

402. Kratka pozicija v 12-mesečnih nestandardiziranih termimskih pogodbah na 3 500 trojanskih unč zlata na londonskem trgu (kratka pozicija v zlatu, dolga pozicija v USD). Poravnana z denarnimi sredstvi. Izvršilna cena: 12-mesečna termimska cena ob koncu dneva na datum knjiženja

Valuta instrumenta EBA: USD

403. Dolga nakupna opcija na 30 000 sodčkov nafte brent (dolga pozicija v nafti Brent, kratka v USD). Poravnana z denarnimi sredstvi. Izvršilna cena: 12-mesečna termimska cena ob koncu dneva na datum knjiženja Datum izteka: datum knjiženja + 6 mesecev

Valuta instrumenta EBA: USD

404. Kratka prodajna opcija na 30 000 sodčkov nafte brent (dolga pozicija v nafti brent, kratka v USD). Poravnana z denarnimi sredstvi. Izvršilna cena: 12-mesečna termimska cena ob koncu dneva na datum knjiženja Datum izteka: datum knjiženja + 6 mesecev

Valuta instrumenta EBA: USD

405. Dolga nakupna opcija na 5 000 trojanskih unč zlata na londonskem trgu (dolga pozicija v zlatu, kratka pozicija v USD). Poravnana z denarnimi sredstvi. Izvršilna cena: 18-mesečna termimska cena ob koncu dneva na datum knjiženja Datum izteka: datum knjiženja + 18 mesecev

Valuta instrumenta EBA: USD

KREDITNI RAZMIK

501. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na Portugalsko

Klavzula o prestrukturiranju: (PO)POLNO

Valuta instrumenta EBA: USD

502. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na Italijo

Klavzula o prestrukturiranju: (PO)POLNO

Valuta instrumenta EBA: USD

503. Kratka (tj. prodaj zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na Španijo

Klavzula o prestrukturiranju: (PO)POLNO

Valuta instrumenta EBA: USD

504. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na Mehiko

Klavzula o prestrukturiranju: (PO)POLNO

Valuta instrumenta EBA: USD

505. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na Brazilijo
Klavzula o prestrukturiranju: (PO)POLNO
Valuta instrumenta EBA: USD
506. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na Združeno kraljestvo
Klavzula o prestrukturiranju: (PO)POLNO
Valuta instrumenta EBA: USD
507. Kratka (tj. prodaj zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 EUR na družbo Telefonica (trgovalna koda: TEF SM)
Valuta instrumenta EBA: EUR
508. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 EUR na družbo Telefonica (trgovalna koda: TEF SM)
Dospelost: december leta T+2
Valuta instrumenta EBA: EUR
509. Kratka (tj. prodaj zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 EUR na družbo Aviva (trgovalna koda: AV LN)
Leto opredelitev ISDA: 2003
Valuta instrumenta EBA: EUR
510. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 EUR na družbo Aviva (trgovalna koda: AV LN)
Leto opredelitev ISDA: 2003
Dospelost: december leta T+2
Valuta instrumenta EBA: EUR
511. Kratka (tj. prodaj zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 EUR na družbo Vodafone (trgovalna koda: VOD LN)
Valuta instrumenta EBA: EUR
512. Kratka (tj. prodaj zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 EUR na družbo ENI SpA (trgovalna koda: ENI IM)
Valuta instrumenta EBA: EUR
513. Kratka (tj. prodaj zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na družbo Eli Lilly (trgovalna koda: LLY US)
Klavzula o prestrukturiranju: brez prestrukturiranja (XR14)
Valuta instrumenta EBA: USD
514. Kratka (tj. prodaj zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 EUR na družbo Unilever (trgovalna koda: UNA NA)
Valuta instrumenta EBA: EUR
515. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 EUR na družbo Total SA (trgovalna koda: FP FP)
Valuta instrumenta EBA: EUR
516. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 EUR na družbo Volkswagen Group (trgovalna koda: VOW GR)
Valuta instrumenta EBA: EUR
517. Dolga pozicija v turških državnih obveznicah v višini 1 000 000 USD (ISIN US900123CT57)
Dospelost: 26. april 2029
Valuta instrumenta EBA: USD

518. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na Turčijo. Datum začetka veljavnosti je datum knjiženja.
Klavzula o prestrukturiranju: (PO)POLNO
Valuta instrumenta EBA: USD
519. Dolga pozicija na obveznice družbe Telefonica v višini 1 000 000 EUR (ISIN XS1681521081)
Dospelost: 12. januar 2028
Valuta instrumenta EBA: EUR
520. Dolga pozicija na obveznice družbe Volkswagen Group v višini 1 000 000 EUR (ISIN XS2234567233)
Dospelost: 22. september 2028
Valuta instrumenta EBA: EUR
521. Kratka pozicija na obveznice družbe Volkswagen Group v višini 1 000 000 EUR (ISIN XS1167667283)
Dospelost: 16. januar 2030
Valuta instrumenta EBA: EUR
522. Dolga pozicija na obveznice družbe Total SA v višini 1 000 000 EUR (ISIN XS1856281834)
Dospelost: 11. julij 2033
Valuta instrumenta EBA: EUR
523. Dolga pozicija v avstrijskih državnih obveznicah v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN AT0000A04967)
Dospelost: 15. marec 2037
Valuta instrumenta EBA: EUR
524. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na Avstrijo
Dospelost: junij leta T+15
Valuta instrumenta EBA: USD
525. Dolga pozicija v nizozemskih državnih obveznicah v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN NL0013552060)
Dospelost: 15. januar 2040
Valuta instrumenta EBA: EUR
526. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na Nizozemsko
Dospelost: junij leta T+20
Valuta instrumenta EBA: USD
527. Dolga pozicija v belgijskih državnih obveznicah v vrednosti 1 000 000 EUR (ISIN BE0000348574)
Dospelost: 22. junij 2050
Valuta instrumenta EBA: EUR
528. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 1 000 000 USD na Belgijo
Dospelost: junij leta T+30
Valuta instrumenta EBA: USD
529. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 10 000 000 EUR na aktualno serijo indeksa iTraxx Europe
Dospelost: junij leta T+4
Valuta instrumenta EBA: EUR

530. Kratka prodajna opcija. 10 000 000 EUR. Osnova aktualna tranša indeksa iTraxx Europe (isti instrument kot 529)
Izvršilna cena: ATM
Datum izteka: datum knjiženja + 6 mesecev
Valuta instrumenta EBA: EUR
531. Dolga pozicija na družbo AXA SA (z možnostjo odpoklica) v višini 1 000 000 EUR (ISIN XS1799611642)
Dospelost: 28. maj 2049
Valuta instrumenta EBA: EUR
532. Dolga pozicija na obveznico družbe AT&T (z možnostjo odpoklica) v višini 1 000 000 USD (ISIN US00206RFW79)
Dospelost: 15. avgust 2037
Valuta instrumenta EBA: USD
533. Dolga pozicija na družbo BAYER AG (z možnostjo odpoklica) v višini 1 000 000 EUR (ISIN XS2199266268)
Dospelost: 6. januar 2030
Valuta instrumenta EBA: EUR
534. Dolga pozicija na obveznico družbe ORANGE SA (z možnostjo odpoklica) v višini 1 000 000 EUR (ISIN FR0013323870)
Dospelost: 20. marec 2028
Valuta instrumenta EBA: EUR

Instrumenti, vključeni v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo (ACTP)

601. Kratka pozicija (tj. prodaj zaščito) v aktualni seriji indeksa iTraxx Europe
Točka vključitve: 3 %
Točka izločitve: 6 %
Nominalni znesek: 5 000 000 EUR
Dospelost: 5 let
Valuta instrumenta EBA: EUR
602. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 5 000 000 EUR na zadnjo aktualno serijo indeksa iTraxx Europe
Dospelost: junij leta T+4
Valuta instrumenta EBA: EUR
Nominalni znesek prilagojen za polno varovanje pred tveganjem CS01 iz 601 brez zahteve po ponovnem zavarovanju.
603. Dolga pozicija (tj. kupi zaščito) v aktualni seriji indeksa iTraxx Europe
Točka vključitve: 3 %
Točka izločitve: 6 %
Nominalni znesek: 5 000 000 EUR
Dospelost: 5 let
Valuta instrumenta EBA: EUR
604. Dolga (tj. prodaj zaščito) kreditna zamenjava v višini 5 000 000 EUR na zadnjo aktualno serijo indeksa iTraxx Europe
Dospelost: junij leta T+4
Valuta instrumenta EBA: EUR
Nominalni znesek prilagojen za polno varovanje pred tveganjem CS01 iz 603 brez zahteve po ponovnem zavarovanju.

605. Kratka pozicija (tj. prodaj zaščito) v aktualni seriji indeksa iTraxx Europe
- Točka vključitve: 12 %
- Točka izločitve: 100 %
- Nominalni znesek: 5 000 000 EUR
- Dospelost: 5 let
- Valuta instrumenta EBA: EUR
606. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 5 000 000 EUR na zadnjo aktualno serijo indeksa iTraxx Europe
- Dospelost: junij leta T+4
- Valuta instrumenta EBA: EUR
- Nominalni znesek prilagojen za polno varovanje pred tveganjem CS01 iz 605 brez zahteve po ponovnem zavarovanju.
607. Dolga pozicija (tj. kupi zaščito) v aktualni seriji indeksa iTraxx Europe
- Točka vključitve: 12 %
- Točka izločitve: 100 %
- Nominalni znesek: 5 000 000 EUR
- Dospelost: 5 let
- Valuta instrumenta EBA: EUR
608. Dolga (tj. prodaj zaščito) kreditna zamenjava v višini 5 000 000 EUR na zadnjo aktualno serijo indeksa iTraxx Europe
- Dospelost: junij leta T+4
- Valuta instrumenta EBA: EUR
- Nominalni znesek prilagojen za polno varovanje pred tveganjem CS01 iz 607 brez zahteve po ponovnem zavarovanju.
609. Kratka pozicija (tj. prodaj zaščito) v aktualni seriji indeksa iTraxx Europe
- Točka vključitve: 3 %
- Točka izločitve: 6 %
- Nominalni znesek: 5 000 000 EUR
- Dospelost: 5 let
- Valuta instrumenta EBA: EUR
- Stopnja izterjave: 40 % fiksna
610. Dolga (tj. kupi zaščito) kreditna zamenjava v višini 5 000 000 EUR na zadnjo aktualno serijo indeksa iTraxx Europe
- Dospelost: junij leta T+4
- Valuta instrumenta EBA: EUR
- Nominalni znesek prilagojen za polno varovanje pred tveganjem CS01 iz 609 brez zahteve po ponovnem zavarovanju.

Oddelek 3: Posamezni portfelji – posamični instrument

Institucije navedejo zahtevane mere tveganja naslednjih posameznih portfeljev, vključno s sedanjo vrednostjo:

Portfelj	Kombinacija instrumentov: prva številka predstavlja instrument (kakor je naveden v oddelku 2 te priloge). Druga številka predstavlja količino vsakega instrumenta ali število pogodb, kot je ustrezno.	Valuta portfelja EBA	Mere tveganja za odobrene notranje modele (VaR, sVaR ter, kadar je ustrezno, IRC in APR), potrebne za postopek	Mere tveganja po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige (SBM, DRC in RRAO), potrebne za postopek
1001	101 – 1 instrument	EUR	ne	da
1002	102 – 1 instrument	EUR	ne	da
1003	103 – 1 instrument	EUR	ne	da
1004	104 – 1 instrument	EUR	ne	da
1005	105 – 1 instrument	EUR	ne	da
1006	106 – 1 instrument	GBP	ne	da
1007	107 – 1 instrument	EUR	ne	da
1008	108 – 1 instrument	EUR	ne	da
1009	109 – 1 instrument	EUR	ne	da
1010	110 – 1 instrument	EUR	ne	da
1011	111 – 1 instrument	USD	ne	da
1012	112 – 1 instrument	USD	ne	da
1013	113 – 1 instrument	EUR	ne	da
1014	114 – 1 instrument	EUR	ne	da
1015	115 – 1 instrument	GBP	ne	da
1016	116 – 1 instrument	GBP	ne	da
1017	117 – 1 instrument	JPY	ne	da
1018	118 – 1 instrument	EUR	ne	da
1019	119 – 1 instrument	EUR	ne	da
1020	120 – 1 instrument	EUR	ne	da
1021	121 – 1 instrument	USD	ne	da
2001	201 – 1 instrument	EUR	ne	da
2002	202 – 1 instrument	EUR	ne	da
2003	203 – 1 instrument	USD	ne	da
2004	204 – 1 instrument	GBP	ne	da
2005	205 – 1 instrument	USD	ne	da
2006	206 – 1 instrument	EUR	ne	da
2007	207 – 1 instrument	EUR	ne	da
2008	208 – 1 instrument	EUR	ne	da
2009	209 – 1 instrument	EUR	ne	da
2010	210 – 1 instrument	EUR	ne	da
2011	211 – 1 instrument	EUR	ne	da

Portfelj	Kombinacija instrumentov: prva številka predstavlja instrument (kakor je naveden v oddelku 2 te priloge). Druga številka predstavlja količino vsakega instrumenta ali število pogodb, kot je ustrezno.	Valuta portfelja EBA	Mere tveganja za odobrene notranje modele (VaR, sVaR ter, kadar je ustrezno, IRC in APR), potrebne za postopek	Mere tveganja po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige (SBM, DRC in RRAO), potrebne za postopek
2012	212 – 1 instrument	EUR	ne	da
2013	213 – 1 instrument	GBP	ne	da
2014	214 – 1 instrument	EUR	ne	da
2015	215 – 1 instrument	USD	ne	da
2016	216 – 1 instrument	USD	ne	da
2017	217 – 1 instrument	USD	ne	da
2018	218 – 1 instrument	EUR	ne	da
2019	219 – 1 instrument	EUR	ne	da
2020	220 – 1 instrument	EUR	ne	da
2021	221 – 1 instrument	EUR	ne	da
2022	222 – 1 instrument	EUR	ne	da
2023	223 – 1 instrument	EUR	ne	da
2024	224 – 1 instrument	EUR	ne	da
3001	301 – 1 instrument	EUR	ne	da
3002	302 – 1 instrument	EUR	ne	da
3003	303 – 1 instrument	EUR	ne	da
3004	304 – 1 instrument	EUR	ne	da
3005	305 – 1 instrument	EUR	ne	da
3006	306 – 1 instrument	EUR	ne	da
3007	307 – 1 instrument	EUR	ne	da
3008	308 – 1 instrument	EUR	ne	da
3009	309 – 1 instrument	EUR	ne	da
3010	310 – 1 instrument	EUR	ne	da
3011	311 – 1 instrument	EUR	ne	da
4001	401 – 1 instrument	USD	ne	da
4002	402 – 1 instrument	USD	ne	da
4003	403 – 1 instrument	USD	ne	da
4004	404 – 1 instrument	USD	ne	da
4005	405 – 1 instrument	USD	ne	da
5001	501 – 1 instrument	USD	ne	da
5002	502 – 1 instrument	USD	ne	da
5003	503 – 1 instrument	USD	ne	da
5004	504 – 1 instrument	USD	ne	da
5005	505 – 1 instrument	USD	ne	da
5006	506 – 1 instrument	USD	ne	da

Portfelj	Kombinacija instrumentov: prva številka predstavlja instrument (kakor je naveden v oddelku 2 te priloge). Druga številka predstavlja količino vsakega instrumenta ali število pogodb, kot je ustrezno.	Valuta portfelja EBA	Mere tveganja za odobrene notranje modele (VaR, sVaR ter, kadar je ustrezno, IRC in APR), potrebne za postopek	Mere tveganja po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige (SBM, DRC in RRAO), potrebne za postopek
5007	507 – 1 instrument	EUR	ne	da
5008	508 – 1 instrument	EUR	ne	da
5009	509 – 1 instrument	EUR	ne	da
5010	510 – 1 instrument	EUR	ne	da
5011	511 – 1 instrument	EUR	ne	da
5012	512 – 1 instrument	EUR	ne	da
5013	513 – 1 instrument	USD	ne	da
5014	514 – 1 instrument	EUR	ne	da
5015	515 – 1 instrument	EUR	ne	da
5016	516 – 1 instrument	EUR	ne	da
5017	517 – 1 instrument	USD	ne	da
5018	518 – 1 instrument	USD	ne	da
5019	519 – 1 instrument	EUR	ne	da
5020	520 – 1 instrument	EUR	ne	da
5021	521 – 1 instrument	EUR	ne	da
5022	522 – 1 instrument	EUR	ne	da
5023	523 – 1 instrument	EUR	ne	da
5024	524 – 1 instrument	USD	ne	da
5025	525 – 1 instrument	EUR	ne	da
5026	526 – 1 instrument	USD	ne	da
5027	527 – 1 instrument	EUR	ne	da
5028	528 – 1 instrument	USD	ne	da
5029	529 – 1 instrument	EUR	ne	da
5030	530 – 1 instrument	EUR	ne	da
5031	531 – 1 instrument	EUR	ne	da
5032	532 – 1 instrument	USD	ne	da
5033	533 – 1 instrument	EUR	ne	da
5034	534 – 1 instrument	EUR	ne	da
6001	601 – 1 instrument	EUR	ne	da
6002	602 – 1 instrument	EUR	ne	da
6003	603 – 1 instrument	EUR	ne	da
6004	604 – 1 instrument	EUR	ne	da
6005	605 – 1 instrument	EUR	ne	da
6006	606 – 1 instrument	EUR	ne	da
6007	607 – 1 instrument	EUR	ne	da

Portfelj	Kombinacija instrumentov: prva številka predstavlja instrument (kakor je naveden v oddelku 2 te priloge). Druga številka predstavlja količino vsakega instrumenta ali število pogodb, kot je ustrezno.	Valuta portfelja EBA	Mere tveganja za odobrene notranje modele (VaR, sVaR ter, kadar je ustrezno, IRC in APR), potrebne za postopek	Mere tveganja po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige (SBM, DRC in RRAO), potrebne za postopek
6008	608 – 1 instrument	EUR	ne	da
6009	609 – 1 instrument	EUR	ne	da
6010	610 – 1 instrument	EUR	ne	da

Oddelek 4: Posamezni portfelji – več instrumentov

Institucije navedejo zahtevane mere tveganja naslednjih posameznih portfeljev, vključno s sedanjo vrednostjo:

Portfelj	Kombinacija instrumentov: prva številka predstavlja instrument (kakor je naveden v oddelku 2 te priloge). Druga številka predstavlja količino vsakega instrumenta ali število pogodb, kot je ustrezno.	Valuta portfelja EBA	Mere tveganja za odobrene notranje modele (VaR, sVaR ter, kadar je ustrezno, IRC in APR), potrebne za postopek	Mere tveganja po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige, potrebne za postopek
1101	103 – 1 instrument 104 – 1 instrument 105 – 1 instrument	EUR	ne	da
1102	113 – 1 instrument 110 – 1 instrument	EUR	ne	da
1103	115 – 1 instrument 116 – 1 instrument	GBP	ne	da
1104	109 – 1 instrument 110 – 1 instrument	EUR	ne	da
1105	111 – 1 instrument 112 – 1 instrument	USD	ne	da
1106	102 – 1 instrument 114 – 1 instrument	EUR	ne	da
1107	106 – 1 instrument 107 – 1 instrument 108 – 1 instrument	EUR	ne	da
1108	101 – 1 instrument 103 – 1 instrument	EUR	ne	da
1109	101 – 1 instrument 103 – 1 instrument 104 – 1 instrument	EUR	ne	da
1110	102 – 1 instrument 104 – 1 instrument	EUR	ne	da
2201	206 – 1 instrument 207 – 1 instrument	EUR	ne	da
2202	206 – 1 instrument 207 – 1 instrument 208 – 1 instrument	EUR	ne	da

Portfelj	Kombinacija instrumentov: prva številka predstavlja instrument (kakor je naveden v oddelku 2 te priloge). Druga številka predstavlja količino vsakega instrumenta ali število pogodb, kot je ustrezno.	Valuta portfelja EBA	Mere tveganja za odobrene notranje modele (VaR, sVaR ter, kadar je ustrezno, IRC in APR), potrebne za postopek	Mere tveganja po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige, potrebne za postopek
2203	206 – 1 instrument 207 – 1 instrument 208 – 1 instrument 209 – 1 instrument 210 – 1 instrument 211 – 1 instrument 212 – 1 instrument	EUR	ne	da
2204	201 – 1 instrument 218 – 1 instrument	EUR	ne	da
2205	201 – 1 instrument 219 – 1 instrument	EUR	ne	da
2206	218 – 1 instrument 219 – 1 instrument	EUR	ne	da
2207	201 – 1 instrument 202 – 1 instrument	EUR	ne	da
2208	215 – 1 instrument 216 – 1 instrument 217 – 1 instrument	USD	ne	da
2209	203 – 1 instrument 215 – 1 instrument	USD	ne	da
2210	208 – 1 instrument 209 – 1 instrument 210 – 1 instrument 214 – 1 instrument	EUR	ne	da
2211	209 – 1 instrument 219 – 1 instrument	EUR	ne	da
2212	201 – 1 instrument 223 – 1 instrument	EUR	ne	da
3301	301 – 1 instrument 302 – 1 instrument	EUR	ne	da
3302	303 – 1 instrument 304 – 1 instrument	EUR	ne	da
3303	304 – 1 instrument 305 – 1 instrument 306 – 1 instrument	EUR	ne	da
3304	307 – 1 instrument 308 – 1 instrument	EUR	ne	da
4401	401 – 1 instrument 402 – 1 instrument	USD	ne	da
4402	403 – 1 instrument 404 – 1 instrument	USD	ne	da
4403	401 – 1 instrument 404 – 1 instrument	USD	ne	da
5501	501 – 1 instrument 502 – 1 instrument 503 – 1 instrument	USD	ne	da

Portfelj	Kombinacija instrumentov: prva številka predstavlja instrument (kakor je naveden v oddelku 2 te priloge). Druga številka predstavlja količino vsakega instrumenta ali število pogodb, kot je ustrezno.	Valuta portfelja EBA	Mere tveganja za odobrene notranje modele (VaR, sVaR ter, kadar je ustrezno, IRC in APR), potrebne za postopek	Mere tveganja po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige, potrebne za postopek
5502	504 – 1 instrument 505 – 1 instrument	USD	ne	da
5503	507 – 1 instrument 508 – 1 instrument	EUR	ne	da
5504	503 – 1 instrument 504 – 1 instrument	USD	ne	da
5505	509 – 1 instrument 510 – 1 instrument	EUR	ne	da
5506	511 – 1 instrument 512 – 1 instrument 514 – 1 instrument 515 – 1 instrument 516 – 1 instrument	EUR	ne	da
5507	517 – 1 instrument 518 – 1 instrument	USD	ne	da
5508	519 – 1 instrument 520 – 1 instrument 522 – 1 instrument	EUR	ne	da
5509	520 – 1 instrument 521 – 1 instrument	EUR	ne	da
5510	519 – 1 instrument 508 – 1 instrument	EUR	ne	da
5511	515 – 1 instrument 522 – 1 instrument	EUR	ne	da
5512	520 – 1 instrument 521 – 1 instrument 516 – 1 instrument	EUR	ne	da
5513	506 – 1 instrument 503 – 1 instrument	USD	ne	da
5514	502 – 1 instrument 209 – 1 instrument	EUR	ne	da
5515	504 – 1 instrument 217 – 1 instrument	USD	ne	da
5516	505 – 1 instrument 216 – 1 instrument	USD	ne	da
5517	504 – 1 instrument 217 – 1 instrument 505 – 1 instrument 216 – 1 instrument	USD	ne	da
5518	502 – 1 instrument 209 – 1 instrument 219 – 1 instrument	EUR	ne	da
5519	523 – 1 instrument 525 – 1 instrument 527 – 1 instrument	EUR	ne	da

Portfelj	Kombinacija instrumentov: prva številka predstavlja instrument (kakor je naveden v oddelku 2 te priloge). Druga številka predstavlja količino vsakega instrumenta ali število pogodb, kot je ustrezno.	Valuta portfelja EBA	Mere tveganja za odobrene notranje modele (VaR, sVaR ter, kadar je ustrezno, IRC in APR), potrebne za postopek	Mere tveganja po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige, potrebne za postopek
5520	524 – 1 instrument 526 – 1 instrument 528 – 1 instrument	USD	ne	da
5521	523 – 1 instrument 524 – 1 instrument 525 – 1 instrument 526 – 1 instrument 527 – 1 instrument 528 – 1 instrument	EUR	ne	da
5522	529 – 1 instrument 530 – 1 instrument	EUR	ne	da
6601	601 – 1 instrument 602 – 1 instrument	EUR	ne	da
6602	603 – 1 instrument 604 – 1 instrument	EUR	ne	da
6603	605 – 1 instrument 606 – 1 instrument	EUR	ne	da
6604	607 – 1 instrument 608 – 1 instrument	EUR	ne	da
6605	609 – 1 instrument 610 – 1 instrument	EUR	ne	da

Oddelek 5: Združeni portfelji

Institucije navedejo zahtevane mere tveganja naslednjih finančnih združenih portfeljev, vključno s sedanjo vrednostjo:

Združeni portfelj	Opis	Kombinacija posameznih portfeljev (posamezni portfelji, kot so navedeni s številkami v oddelkih 3 in 4 te priloge)	Valuta portfelja EBA	Mere tveganja za odobrene notranje modele (VaR, sVaR ter, kadar je ustrezno, IRC in APR), potrebne za postopek	Mere tveganja po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige, potrebne za postopek
10000	VSI brez CPT	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	ne	da
11000	LASTNIŠKI INSTRUMENTI kumulativno	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	ne	da
12000	OBRETNOSTNE MERE kumulativno	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	ne	da
13000	VALUTE kumulativno	3301, 3303, 3304	EUR	ne	da

Združeni portfelj	Opis	Kombinacija posameznih portfeljev (posamezni portfelji, kot so navedeni s številkami v oddelkih 3 in 4 te priloge)	Valuta portfelja EBA	Mere tveganja za odobrene notranje modele (VaR, sVaR ter, kadar je ustrezno, IRC in APR), potrebne za postopek	Mere tveganja po alternativnem standardiziranem pristopu glede na temeljni pregled trgovalne knjige, potrebne za postopek
14000	Blago kumulativno	4401, 4402	USD	ne	da
15000	Kreditni razmik kumulativno	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	ne	da
16000	Trgovalni portfelj s korelacijo kumulativno EUR	6601, 6602	EUR	ne	da

Oddelek 6: Dodatne specifikacije za instrumente

Institucije za finančne instrumente, opisane v oddelku 2 te priloge, uporabljajo naslednje dodatne specifikacije:

Instrument	220
Opis	petletna medvalutna zamenjava EUR/USD po trenutni tržni ceni prejem USD in plačilo EUR Nominalni znesek: 10 000 000 EUR, (10 000 000 EUR * tečaj USD/EUR) USD
Plačilo	stran s spremenljivo obrestno mero 2
Prejem	stran s spremenljivo obrestno mero 1
Izmenjava in ponastavitev nominalnega zneska	Na datum začetka veljavnosti in datum dospelosti. Poleg tega se na vsak datum plačila kupona izvede dodatno plačilo, ki ustreza prilagoditvi nominalnega zneska v USD na strani s spremenljivo obrestno mero 2. Nominalni znesek v USD se prilagodi na 10 000 000 EUR po promptnem tečaju 2 delovna dneva pred vsakim datumom plačila.
Stanje denarnih sredstev	vključeno
Stran s spremenljivo obrestno mero 1	
Nominalni znesek	enakovreden 10 000 000 EUR, preračunanim v USD po promptnem tečaju na datum začetka veljavnosti, četrtno prilagajanje enakovrednega zneska
Datum začetka veljavnosti	datum knjiženja + 6 mesecev
Datum dospelosti	datum knjiženja + 5,5 let
Določitev datumov plačila	po datumu uveljavitve
Pogostost izplačila kupona	četrtno
Kuponska obrestna mera	trimesečna referenčna mera SOFR (čeznočna SOFR, konformna dnevna) + 0 bazičnih točk
Pogostost ponastavitve kuponske obrestne mere	četrtno
Dogovor o določanju kuponske obrestne mere	konformna dnevna v trimesečnem obdobju
Pogostost združevanja kuponske obrestne mere	enostavne obresti
Štetje dni	dejansko/360

Delovni dan plačila	LON, NYC, TARGET
Dogovor o delovnih dneh plačila	prilagojeni naslednji delovni dan
Delovni dan ponastavitve nominalnega zneska	LON, NYC, TARGET
Dogovor o delovnih dneh ponastavitve nominalnega zneska	prejšnji
Delovni dan ponastavitve kuponske obrestne mere	LON, NYC, TARGET
Dogovor o delovnih dneh ponastavitve kuponske obrestne mere	prejšnji
<i>Stran s spremenljivo obrestno mero 2</i>	
Nominalni znesek	10 000 000 EUR
Datum začetka veljavnosti	datum knjiženja + 6 mesecev
Datum dospelosti	datum knjiženja + 5,5 let
Določitev datumov plačila	po datumu uveljavitve
Pogostost izplačila kupona	četrtno
Kuponska obrestna mera	3-mesečna ESTER + 0 bazičnih točk
Pogostost ponastavitve kuponske obrestne mere	četrtno
Dogovor o določanju kuponske obrestne mere	konformna dnevna v trimesečnem obdobju
Pogostost združevanja kuponske obrestne mere	enostavne obresti
Štetje dni	dejansko/360
Delovni dan plačila	LON, NYC, TARGET
Delovni dan plačila	prilagojeni naslednji delovni dan
Delovni dan ponastavitve nominalnega zneska	LON, NYC, TARGET
Dogovor o delovnih dneh ponastavitve nominalnega zneska	prejšnji
Delovni dan ponastavitve kuponske obrestne mere	LON, NYC, TARGET
Dogovor o delovnih dneh ponastavitve kuponske obrestne mere	prejšnji

Oddelek 7: Portfelji za validacijo SBM

- (a) Institucije zagotovijo mero tveganja po SBM za portfelje, opredeljene v Prilogi X (portfelji za validacijo SBM), kot del predložitve začetne ocene tržne vrednosti in jo predložijo v skladu z datumi poročanja za predložitev začetne ocene tržne vrednosti.
 - (b) Za predložitev rezultatov, ki ustrezajo portfeljem za validacijo SBM, velja naslednje:
 - (i) institucije poročajo samo predlogo C 106.02;
 - (ii) institucije predpostavljajo, da so občutljivosti na tveganje in pozicije tveganja ukrivljenosti, opredeljene z instrumenti iz Priloge X, izražene v valuti poročanja institucije in da so informacije zagotovljene v obliki, določeni v navodilih za poročanje za predloge C106.01/C120.01 in ustrezni tabeli z navodili za poročanje teh predlog iz Priloge VI (Navodila za predlogo). Kadar je instrument, ki tvori del portfelja za validacijo, določenega v Prilogi X, povezan s tveganjem ukrivljenosti, bi morale banke upoštevati pozicije za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzgor in navzdol, ki se navedejo pod isto številko instrumenta, vendar v ločenih vrsticah v okviru instrumentov, določenih v Prilogi X.“.
-

PRILOGA III

„PRILOGA VI

REZULTATI PORTFELJEV ZA NADZORNIŠKO PRIMERJANJE

NAVODILA V ZVEZI S PREDLOGAMI 2

C 106.00 – Začetna tržna vrednost in utemeljitev izključitve	47
C 106.01 – SBM. Občutljivosti na tveganja po instrumentu	47
C 106.02 – SBM. Sestava kapitalskih zahtev (OFR) po portfeljih za validacijo SBM	52
C 107.01 – VaR in sVaR za trgovalne portfelje brez korelacije. Podatki	53
C 107.02 – VaR, sVaR in PV za trgovalne portfelje brez korelacije. Rezultati v valuti portfelja EBA	56
C 108.00 – Časovna vrsta podatkov o poslovnem izidu	57
C 109.01 – IRC. Podatki o modelu	57
C 109.02 – IRC. Podatki po portfeljih	58
C 109.03 – IRC. Znesek po portfelju/datumu	59
C 110.01 – Podatki o modelu za trgovanje s korelacijo	60
C 110.02 – Podatki po portfeljih za trgovanje s korelacijo	60
C 110.03 – Vs a cenovna tveganja (APR) po portfeljih/datumu za trgovanje s korelacijo	61
C 120.01 – SBM. OBČUTLJIVOSTI NA TVEGANJA PO INSTRUMENTU/PORTFELJU	62
C 120.02 – SBM. SESTAVA KAPITALSKIH ZAHTEV PO PORTFELJIH	66
C 120.04 – DRC. TRŽNE VREDNOSTI IN BRUTO ZNESKI SKOKOVITEGA NARAŠČANJA VERJETNOSTI NEPLAČILA (JTD) PO INSTRUMENTIH/PORTFELJIH	68
C 120.05 – DRC. SESTAVA KAPITALSKIH ZAHTEV PO PORTFELJIH	74
C 120.06 – ASA. KAPITALSKE ZAHTEVE	77

NAVODILA V ZVEZI S PREDLOGAMI

C 106.00 – Začetna tržna vrednost in utemeljitev izključitve

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Številka instrumenta	Priloga V, oddelek 2, k tej uredbi	Poroča se številka instrumenta iz Priloge V k tej uredbi.
0020	Modeliranost instrumenta za VaR in sVaR (DA/NE)		— Poroča se DA ali NE.
0030	Modeliranost instrumenta za IRC (DA/NE)		— Poroča se DA ali NE.
0040	Modeliranost instrumenta za trgovanje s korelacijo (DA/NE)		Poroča se DA ali NE.
0050	Utemeljitev izključitve	člen 3(2)	Poroča se ena od naslednjih možnosti: (a) regulativni organ ni odobril modela, (b) instrument ali osnova ni notranje odobrena, (c) osnova ali značilnost modeliranja se ne upošteva interno, (d) drugi razlogi za izključitev. Utemeljitev navedite v stolpcu 0060.
0060	Polje za prosto besedilo		Institucija lahko v tem stolpcu navede dodatne informacije.
0070	Začetna tržna vrednost (IMV)		Tekoča tržna vrednost vsakega instrumenta na referenčni datum ob 17.30 po srednjeevropskem času (kot je navedeno v Prilogi V, oddelek 1, točka (b), k tej uredbi. Celica se pusti prazna, kadar institucija ne želi navesti IMV za določen portfelj (tj. vrednost nič se poroča samo, kadar je rezultat izračuna enak nič).

C 106.01 – SBM. Občutljivosti na tveganja po instrumentu

Institucije poročajo občutljivosti na dejavnike tveganja, ki jim je izpostavljen instrument. Poroča se ena vrstica na dejavnik tveganja/občutljivost. V posameznih vrsticah se poroča neto pozicija za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzgor za ta dejavnik tveganja (CVRk+) ali neto pozicija za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzdol za ta dejavnik tveganja (CVRk–), kot je določeno v členu 325g Uredbe (EU) št. 575/2013. Vse vrednosti se nanašajo na referenčni datum začetne ocene tržne vrednosti (in začetne predložitve metode na podlagi občutljivosti), kot je določen v oddelku 1, točka (b)(ii), Priloge V k tej uredbi. Institucije samo enkrat poročajo vsako kombinacijo številke instrumenta, identifikatorja tveganja (stolpec 0010), skupine (stolpec 0020) in dodatnega identifikatorja (stolpec 0030).

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Številka instrumenta	Oddelek 2 Priloge V	Poroča se številka instrumenta iz Priloge V.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Identifikator dejavnika tveganja	Členi 325l, 325m, 325n, 325o, 325p in 325q Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se identifikator dejavnika tveganja, kot je določen v razpredelnici na koncu te priloge.
0020	Skupina	Člen 325d(3) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se skupina; kadar identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0010, ustreza razredu tveganja: — splošno obrestno tveganje, je odgovor ime valute zadevnega dejavnika tveganja netvegane obrestne mere, inflacije ali medvalutnega tveganja osnove (na podlagi oznake valute po ISO 4217, npr. ‚EUR‘), — tveganje kreditnega razmika za nelistinjenje, je odgovor številka skupine iz člena 325ah(1), razpredelnica 4, Uredbe (EU) št. 575/2013, — tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki ni vključeno v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo, je odgovor številka skupine iz člena 325am(1), razpredelnica 7, navedene uredbe, — tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki je vključeno v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo, je odgovor številka skupine iz člena 325ak, razpredelnica 6, navedene uredbe, — tveganje lastniških vrednostnih papirjev, je odgovor številka skupine iz člena 325ap(1), razpredelnica 8, navedene uredbe, — blagovno tveganje, je odgovor številka skupine iz člena 325as, razpredelnica 9, navedene uredbe, — valutno tveganje in sestavini delta ali ukrivljenost, je odgovor ime valute (npr. ‚USD‘; poročane kode valute ustrezajo oznaki valute po ISO 4217), — valutno tveganje in sestavina vega, je odgovor ime valutnega para (npr. ‚EUR_USD‘; poročane kode valute ustrezajo oznaki valute po ISO 4217).

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0030	Dodatni identifikator 1	Členi 325l do 325q in člen 325ai Uredbe (EU) št. 575/2013	Poročajo se naslednje informacije o razlikovanju dejavnika tveganja na ravni znotraj skupin. Kadar identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0010, ustreza razredu tveganja: — splošno obrestno tveganje in sestavina delta, je odgovor ime krivulje netvegane obrestne mere ali drugega ustreznega edinstvenega identifikatorja, — tveganje kreditnega razmika za nelistinjenje ali razred tveganja kreditnega razmika za listinjenje, ki je vključeno v alternativni trgovni portfelj s korelacijo (ACTP CSR), je odgovor LEI izdajatelja in je identičen za kateri koli dve poročani občutljivosti na dva dejavnika tveganja, kjer je korelacijski parameter $\rho_{kl}^{(name)}$ enak 1 v skladu s členom 325ai(1) Uredbe (EU) št. 575/2013, — tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki ni vključeno v alternativni trgovni portfelj s korelacijo, je odgovor ime tranše ali drug ustrezen edinstveni identifikator, — tveganje lastniških vrednostnih papirjev, je odgovor koda ISIN osnovnega instrumenta, — blagovno tveganje, je odgovor ime blaga ali drug ustrezeni edinstveni identifikator. Kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov, institucije poročajo določeno vrednost (NULL) kot nerelevantno.
0050	Občutljivost na tveganje (rezultati v valuti poročanja)	Člen 325d(2) in členi 325g, 325r, 325s, 325 t in 325ax Uredbe (EU) št. 575/2013	Občutljivosti na tveganja (občutljivosti delta/vega in pozicije tveganja ukrivljenosti) se poročajo na ravni vsakega instrumenta za vse relevantne dejavnike tveganja iz stolpcev 0010 do 0030. Vrednosti se poročajo v valuti poročanja institucije. Kadar identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0010, ustreza: — sestavini delta tveganja metode na podlagi občutljivosti, se poroča neto občutljivost na dejavnik tveganja (S_k), kot je določeno v členu 325r Uredbe (EU) št. 575/2013. Če so institucije pridobile dovoljenje svojega pristojnega organa za uporabo alternativnih definicij občutljivosti na delta tveganje v skladu s členom 325t(5) navedene uredbe, se za poročanje sklicujejo na te alternativne opredelitve;

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			— sestavini vega tveganja metode na podlagi občutljivosti, se poroča občutljivost na vega tveganje opcije na dani dejavnik tveganja (S_k), kot je določeno v členu 325s Uredbe (EU) št. 575/2013. Če so institucije pridobile dovoljenje svojega pristojnega organa za uporabo alternativnih izračunov občutljivosti na vega tveganje v skladu s členom 325t(6) navedene uredbe, se za poročanje sklicujejo na te alternativne izračune. Ne glede na to, ali institucija uporablja opredelitev iz člena 325s ali alternativni izračun v skladu s členom 325t(6) navedene uredbe, se občutljivost poroča po tehtanju z ustrezno implicitno nestanovitnostjo; — sestavini tveganja ukrivljenosti metode na podlagi občutljivosti, se poroča neto pozicija za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzgor za ta dejavnik tveganja (CVR_k^+) ali neto pozicija za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzdol za ta dejavnik tveganja (CVR_k^-), kot je določeno v členu 325g Uredbe (EU) št. 575/2013. Poročana vrednost se izrazi z decimalnim številom na vsaj dve decimalni mesti natančno. Vrednost nič se poroča samo, kadar je rezultat izračuna res nič.
0060	Valuta poročanja		Poroča se ime valute poročanja institucije (poročane vrednosti ustrezajo oznaki valute po ISO 4217, npr. 'EUR').
0070	Občutljivost na tveganje (rezultati v valuti instrumenta EBA)	Oddelek 2 Priloge V k tej uredbi in člen 325d(2) ter členi 325g, 325r in 325s Uredbe (EU) št. 575/2013	Vrednosti se poročajo v skladu z navodili za stolpec 0050, vendar se pretvorijo po promptnem menjalnem tečaju ECB, povezanem z valuto instrumenta, kot je določena v oddelku 2 Priloge V k tej uredbi.
0080	Model določanja cen	Člen 325t Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucija določi, kateri model oblikovanja cen se uporablja za izpeljavo občutljivosti. Poroča se ena od naslednjih možnosti: (a) 'modeli določanja cen institucije, ki so podlaga za poročanje o poslovnem izidu višjemu vodstvu' (kot v členu 325t(1), prvi pododstavek, Uredbe (EU) št. 575/2013), (b) 'pristop notranjih modelov institucije' (kot v členu 325t(1), drugi pododstavek, navedene uredbe).

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0090	Opredelitev občutljivosti	Členi 325r, 325s in 325t Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucija določi, katera opredelitev občutljivosti se uporablja pri izračunu kapitalskih zahtev. Poroča se ena od naslednjih možnosti: (a) opredelitev občutljivosti v členih 325r in 325s Uredbe (EU) št. 575/2013, (b) opredelitev občutljivosti v skladu s členom 325t(5) in (6) Uredbe (EU) št. 575/2013. Če identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0010, ustreza sestavini tveganja ukrivljenosti metode na podlagi občutljivosti, se poroča vrednost iz točke (b), če katera koli občutljivost, uporabljena pri izračunu poročane pozicije za tveganje ukrivljenosti, temelji na opredelitvi občutljivosti v skladu s členom 325t(5) in (6) Uredbe (EU) št. 575/2013, sicer se poroča vrednost iz točke (a).
0100	Polje za prosto besedilo		Institucija lahko v tem stolpcu navede dodatne informacije v zvezi z uporabljenim modelom določanja cen in opredelitvijo občutljivosti.
0110	Dodatni identifikator 2	Člen 325p(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Če identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0010, ustreza razredu tveganja ‚blagovno tveganje in sestavina delta tveganja‘ metode na podlagi občutljivosti, je odgovor sklop pravnih pogojev v zvezi z lokacijo izročitve blaga ali drug ustrezeni edinstveni identifikator. Kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov, institucije poročajo določeno vrednost (NULL) kot nerelevantno.
0120	Kategorija kreditne kakovosti	Člen 325m(1) in člen 325ah(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	Če identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0010, ustreza razredu tveganja ‚tveganje kreditnega razmika za nelistinjenje in sestavina delta tveganja‘ metode na podlagi občutljivosti, je odgovor eno od naslednjega: (a) ‚CQS 1‘, (b) ‚CQS 2‘, (c) ‚CQS 3‘, (d) ‚CQS 4‘, (e) ‚CQS 5‘, (f) ‚CQS 6‘, (g) ‚CQS ni dodeljena (brez bonitetne ocene)‘. Kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov, institucije poročajo določeno vrednost (NULL) kot nerelevantno.

C 106.02 – SBM. Sestava kapitalskih zahtev (OFR) po portfeljih za validacijo SBM

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Priloga V, oddelek 7, k tej uredbi	Poroča se številka portfelja iz Priloge X k tej uredbi.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Razred tveganja	Člen 325d(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se razred tveganja. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) ‚splošno obrestno tveganje (GIRR)‘, (b) ‚tveganje kreditnega razmika: tveganje kreditnega razmika za nelistinjenje‘, (c) ‚tveganje kreditnega razmika: tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki ni vključeno v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo‘, (d) ‚tveganje kreditnega razmika: tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki je vključeno v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo‘, (e) ‚tveganje lastniških finančnih instrumentov‘, (f) ‚blagovno tveganje‘, (g) ‚valutno tveganje‘.
0020	Sestavina	Člen 325e(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se sestavina metode na podlagi občutljivosti. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) ‚delta tveganje‘, (b) ‚vega tveganje‘, (c) ‚tveganje ukrivljenosti‘.
0030	Scenarij korelacije	Člen 325h Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se scenarij korelacije. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) ‚scenarij srednjih korelacij‘, (b) ‚scenarij visokih korelacij‘, (c) ‚scenarij nizkih korelacij‘.
0040	Kapitalske zahteve (rezultati v valuti poročanja)	Člen 325h Uredbe (EU) št. 575/2013	Vrednosti kapitalskih zahtev se poročajo za ‚referenčni datum začetne ocene tržne vrednosti‘ (kot je določen v Prilogi V, oddelek 1, točka (b), k tej uredbi) za vsak portfelj za vse ustrezne kombinacije razreda tveganja, sestavine in scenarija korelacij. Vrednosti se poročajo v valuti poročanja institucije in so izražene na vsaj na dve decimalni mesti natančno.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0050	Predložitev rezultatov portfeljev za validacijo SBM	Člen 325e(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) ‚predloženi‘, če institucija predloži rezultate, ki ustrezajo temu portfelju; (b) ‚niso predloženi – ni izpostavljenosti do dejavnika tveganja‘, če se institucija odloči, da ne bo predložila rezultatov za zadeven portfelj za validacijo SBM, ker ni notranje odobritve uprave te institucije, da lahko posluje z instrumenti, ki bi ustvarili izpostavljenost do zadevnega dejavnika tveganja.
0060	Polje za prosto besedilo		Institucija lahko v tem stolpcu navede dodatne informacije.

C 107.01 – VaR in sVaR za trgovalne portfelje brez korelacije. Podatki

Vrstica	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010–0060	Tvegana vrednost (VaR)		
0010	Metodologija		V stolpcu 0010 se poroča ena od naslednjih možnosti: (a) zgodovinska simulacija, (b) simulacija Monte Carlo, (c) parametrična metodologija, (d) kombinacija/druga metodologija (navedite). Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010. Če je bila v stolpcu 0010 izbrana možnost (d), institucija podatke navede v stolpcu 0020.
0020	Izračun 10-dnevnega obdobja	Člen 365(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	V stolpcu 0010 se poroča ena od naslednjih možnosti: (a) 1 dan, ki se prilagodi navzgor na obdobje 10 dni, (b) 10 dni z obdobji, ki se prekrivajo, (c) druga metoda z 10 dnevi. Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010.
0030	Dolžina obdobja spremljanja	Člen 365(1), točka (d), Uredbe (EU) št. 575/2013	V stolpcu 0010 se poroča ena od naslednjih možnosti: (a) do 1 leto, (b) več kot 1 in do 2 leti, (c) več kot 2 in do 3 leta, (d) več kot 3 leta. Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010.

Vrstica	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0040	Tehtanje podatkov	Člen 365(1), točka (d), Uredbe (EU) št. 575/2013	V stolpcu 0010 se poroča ena od naslednjih možnosti: (a) netehtani (tehtanje podatkov VaR), (b) tehtani (tehtanje podatkov VaR), (c) višja izmed tehtanih in netehtanih (tehtanje podatkov o VAR) iz točk (a) in (b). Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010.
0050	Prištevek za testiranje za nazaj	Člen 366(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Prištevek za testiranje za nazaj pomeni prištevek med 0 in 1 v skladu s členom 366(2), razpredelnica 1, Uredbe (EU) št. 575/2013. Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010.
0060	Regulativni prištevek za tvegano vrednost (VaR)	Člen 366(2) Uredbe (EU) št. 575/2013 (najmanj 3')	Regulativni prištevek za VaR pomeni dodatek, ki ga določi pristojni organ za multiplikator za tvegano vrednost (ki je enak najmanj 3) v skladu s členom 366(2) Uredbe (EU) št. 575/2013. Regulativni prištevek za VaR je vsota pribitka za testiranje za nazaj in kvalitativnega prištevka, kjer je to ustrezno, ki presega 3. Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010.
0070–0100	Stresna tvegana vrednost (sVaR)		
0070	Metodologija		V stolpcu 0010 se poroča ena od naslednjih možnosti: (a) zgodovinska simulacija, (b) simulacija Monte Carlo, (c) parametrična metodologija, (d) kombinacija/druga metodologija (navedite). Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010. Kadar je bila v stolpcu 0010 izbrana možnost (d), institucija podatke navede v stolpcu 0020.
0080	Izračun 10-dnevnega obdobja	Člen 365(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	V stolpcu 0010 se poroča ena od naslednjih možnosti: (a) 1 dan, ki se prilagodi navzgor na obdobje 10 dni, (b) 10 dni z obdobji, ki se prekrivajo, (c) druga metoda z 10 dnevi. Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010.

Vrstica	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0090	Regulativni prištevek za stresno tvegano vrednost (sVaR)	Člen 366(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Regulativni prištevek pomeni dodatek, ki ga določi pristojni organ za multiplikator za stresno tvegano vrednost (ki je enak najmanj 3) v skladu s členom 366(2) Uredbe (EU) št. 575/2013. Regulativni prištevek je vsota 3, pribitka za testiranje za nazaj in kvalitativnega prištevk (kjer je ustrezno). Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010.
0100	Obdobje za stresno tvegano vrednost (sVaR)	Člen 365(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	V stolpcu 0010 se poroča ena od naslednjih možnosti: (a) dnevni izračun stresne tvegane vrednosti (sVaR), umerjene na eno neprekinjeno 12-mesečno obdobje z začetkom na datum, določen v stolpcu 0020, (b) tedenski izračun stresne tvegane vrednosti (sVaR), umerjene na eno neprekinjeno 12-mesečno obdobje z začetkom na datum, določen v stolpcu 0020, (c) dnevni izračun stresne tvegane vrednosti (sVaR), umerjene na različna neprekinjena 12-mesečna obdobja v okviru datumov poročanja sVaR, navedenih v stolpcu 0010 predloge C107.02, z začetkom na datume, določene v stolpcu 0020, (d) tedenski izračun stresne tvegane vrednosti (sVaR), umerjene na različna neprekinjena 12-mesečna obdobja v okviru datumov poročanja sVaR, navedenih v stolpcu 0010 predloge C107.02, z začetkom na datume, določene v stolpcu 0020, (e) najvišja vrednost dnevnih izračunov stresne tvegane vrednosti (sVaR), umerjene na več kot eno 12-mesečno obdobje, (f) najvišja vrednost tedenskih izračunov stresne tvegane vrednosti (sVaR), umerjene na več kot eno 12-mesečno obdobje, (g) druge izbire za umerjanje stresne tvegane vrednosti (sVaR) (navedite). Institucija uporabi stolpec 0020 za navedbo datuma začetka v obliki 'dd/mm/yyyy' v primeru možnosti (a) ali (b) iz stolpca 0010 in datumov začetka v obliki 'f,dd/mm/yyyy', ki se uporabljajo za vsak izračun stresne tvegane vrednosti v primeru možnosti (c) ali (d) iz stolpca 0010. Institucije stolpec 0020 uporabijo tudi za pojasnilo v zvezi z 12-mesečnim obdobjem, ki se uporablja za vsak izračun sVaR pri možnostih (e), (f) in (g), navedenih v stolpcu 0010.

C 107.02 – VaR, sVaR in PV za trgovanje portfelje brez korelacije. Rezultati v valuti portfelja EBA

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Datum		Rezultati VaR, sVaR in sedanje vrednosti (PV) se poročajo za vseh 10 delovnih dni med ,začetnim referenčnim datumom mer tveganja' in ,končnim referenčnim datumom mer tveganja (in končnim referenčnim datumom alternativnega standardiziranega pristopa)', kot sta določena v oddelku 1, točka (b), Priloge V. Za poročanje datumov se uporablja dogovor ,dd/mm/llll'.
0020	Tvegana vrednost (VaR)	Člen 365 Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se 10-dnevna regulativna tvegana vrednost, pridobljena za vsak portfelj, brez uporabe regulativnega multiplikatorja ,najmanj 3'. Številčni podatki se poročajo za vsak datum iz stolpca 0010. Celica se pusti prazna, kadar institucija ne izračuna tvegane vrednosti na datum iz stolpca 0010 (tj. vrednost nič se poroča samo, kadar je rezultat izračuna enak nič).
0030	Stresna tvegana vrednost (sVaR)	Člen 365 Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se 10-dnevna regulativna stresna tvegana vrednost, pridobljena za vsak portfelj, brez uporabe regulativnega multiplikatorja ,najmanj 3'. Številčni podatki se poročajo za vsak datum iz stolpca 0010. Celica se pusti prazna, kadar institucija ne izračuna stresne tvegane vrednosti na datum iz stolpca 0010 (tj. vrednost nič se poroča samo, kadar je rezultat izračuna enak nič).
0040	Sedanja vrednost (PV)		Poroča se sedanja vrednost za vsak portfelj. Številčni podatki se poročajo za vsak datum iz stolpca 0010. Celica se pusti prazna, kadar institucija ne izračuna sedanje vrednosti na datum iz stolpca 0010 (tj. vrednost nič se poroča samo, kadar je rezultat izračuna enak nič).

C 108.00 – Časovna vrsta podatkov o poslovnem izidu

Predlogo C 108.00 („Časovna vrsta podatkov o poslovnem izidu“) izpolnijo samo institucije, ki izračunavajo tvegano vrednost z uporabo zgodovinske simulacije.

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Datum	Člen 365(1), točka (d), Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucije vsak delovni dan, določen v skladu s koledarjem v jurisdikciji institucije, predložijo serijo podatkov o poslovnem izidu, ki se uporablja za izračun tvegane vrednosti v predlogi C 107.02, stolpec 0010, z najmanj 250 opazovanji za nazaj od „končnega referenčnega datuma mer tveganja (in končnega referenčnega datuma alternativnega standardiziranega pristopa)“, kot je določen v oddelku 1, točka (b)(v), Priloge V.
0020	Dnevni poslovni izid		Institucije, ki izračunavajo tvegano vrednost z zgodovinsko simulacijo, izpolnijo celotno zgodovinsko serijo, ki jo uporablja institucija, z najmanj enoletno podatkovno serijo, s spremembo vrednosti portfelja (tj. dnevni poslovni izid), dobljeno z uporabo zgodovinsko simuliranih dnevnih sprememb dejavnikov tveganja (tj. serije dnevnega poslovnega izida, ki se uporabljajo za izpeljavo enodnevne regulativne tvegane vrednosti). Če je dan v zadevni jurisdikciji praznik, se ta celica pusti prazna (tj. ničelni poslovni izid se poroča samo, kadar ni prišlo do spremembe hipotetične vrednosti portfelja na dani delovni dan).

C 109.01 – IRC. Podatki o modelu

Vrstica	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Število dejavnikov za modeliranje		EBA/GL/2012/3 Poroča se število dejavnikov za modeliranje na ravni celotnega modela IRC. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) 1 dejavnik za modeliranje, (b) 2 dejavnika za modeliranje, (c) več kot 2 dejavnika za modeliranje. Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010.

Vrstica	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0020	Vir izgub ob neplačilu (LGD)		EBA/GL/2012/3 Poroča se vir LGD na ravni celotnega modela IRC. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) ustaljena tržna praksa, (b) LGD, ki se uporablja pri modelu IRB, (c) drug vir LGD (navedite). Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010. Če je bila v stolpcu 0010 izbrana možnost (c), institucija podatke navede v tem stolpcu.

C 109.02 – IRC. Podatki po portfeljih

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V, in sicer samo za tiste portfelje, za katere se zahteva IRC.

Vrstica	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Obdobje likvidnosti	Člen 374(5) Uredbe (EU) št. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Poroča se obdobje likvidnosti, ki se uporablja na ravni portfelja. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) do 3 meseci, (b) več kot 3 in do 6 mesecev, (c) več kot 6 in do 9 mesecev, (d) več kot 9 in do 12 mesecev.
0020	Vir verjetnosti neplačila		EBA/GL/2012/3 Poroča se vir verjetnosti neplačila, ki se uporablja na ravni portfelja. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) bonitetne agencije, (b) pristop IRB, (c) tržno določene verjetnosti neplačila, (d) drug vir verjetnosti neplačila (navedite). Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010. Kadar je bila v stolpcu 0010 izbrana možnost (d), institucija podatke navede v stolpcu 0020.

Vrstica	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0030	Vir matrik prehoda		EBA/GL/2012/3 Poroča se vir matrik prehoda, ki se uporablja na ravni portfelja. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) bonitetne agencije, (b) pristop IRB, (c) tržno določene matrike prehoda, (d) drugi viri matrik prehoda (navedite). Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010. Kadar je bila v stolpcu 0010 izbrana možnost (d), institucija podatke navede v stolpcu 0020.

C 109.03 – IRC. Znesek po portfelju/datumu

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V, in sicer samo za tiste portfelje, za katere se zahteva IRC.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Datum		IRC se poroča za vseh 10 delovnih dni med ,začetnim referenčnim datumom mer tveganja' in ,končnim referenčnim datumom mer tveganja (in končnim referenčnim datumom alternativnega standardiziranega pristopa)', kot je določen v oddelku 1, točka (b), Priloge V. Za poročanje datumov se uporablja dogovor ,dd/mm/yyyy'.
0020	Presežno tveganje neplačila in migracije (IRC)	Členi 372 do 376 Uredbe (EU) št. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Poroča se regulativni IRC, izračunan za vsak portfelj. Številčni podatki se poročajo za vsak datum iz stolpca 0010. Celica se pusti prazna, kadar institucija ne izračuna IRC na datum, poročan v stolpcu 0010 (tj. vrednost nič se poroča samo, kadar je rezultat izračuna enak nič).

C 110.01 – Podatki o modelu za trgovanje s korelacijo

Vrstica	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Število dejavnikov za modeliranje	Člen 377 Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se število dejavnikov modeliranja na ravni celotnega modela trgovanja s korelacijo. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) 1 dejavnik za modeliranje, (b) 2 dejavnika za modeliranje, (c) več kot 2 dejavnika za modeliranje. Institucija uporabi stolpec 0020, če želi pojasniti odgovor iz stolpca 0010.
0020	Vir izgub ob neplačilu (LGD)	Člen 377 Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se vir izgub ob neplačilu na ravni celotnega modela trgovanja s korelacijo. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) ustaljena tržna praksa, (b) LGD, ki se uporablja pri modelu IRB, (c) drugi viri LGD (navedite). Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010. Če je bila v stolpcu 0010 izbrana možnost (c), institucija podatke navede v tem stolpcu.

C 110.02 – Podatki po portfeljih za trgovanje s korelacijo

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V, in sicer samo za tiste portfelje, za katere se zahteva APR.

Vrstica	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Obdobje likvidnosti	Člen 377(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se obdobje likvidnosti, ki se uporablja na ravni portfelja. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) do 3 meseci, (b) več kot 3 in do 6 mesecev, (c) več kot 6 in do 9 mesecev, (d) več kot 9 in do 12 mesecev.

Vrstica	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0020	Vir verjetnosti neplačila	Člen 377 Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se vir verjetnosti neplačila, ki se uporablja na ravni portfelja. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) bonitetne agencije, (b) pristop IRB, (c) tržno določene verjetnosti neplačila, (d) drug vir verjetnosti neplačila (navedite). Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010. Kadar je bila v stolpcu 0010 izbrana možnost (d), institucija podatke navede v stolpcu 0020.
0030	Vir matrik prehoda	Člen 377 Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se vir matrik prehoda, ki se uporablja na ravni portfelja. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) bonitetne agencije, (b) pristop IRB, (c) tržno določene matrike prehoda, (d) drug vir matrik prehoda (navedite). Institucija uporabi stolpec 0020 za pojasnitev odgovora iz stolpca 0010. Kadar je bila v stolpcu 0010 izbrana možnost (d), institucija podatke navede v stolpcu 0020.

C 110.03 – Vsa cenovna tveganja (APR) po portfeljih/datumu za trgovanje s korelacijo

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V, in sicer samo za tiste portfelje, za katere se zahteva APR.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Datum	Člen 377 Uredbe (EU) št. 575/2013	Vsa cenovna tveganja (APR) se poročajo za vseh 10 delovnih dni med 'začetnim referenčnim datumom mer tveganja' in 'končnim referenčnim datumom mer tveganja' (in končnim referenčnim datumom alternativnega standardiziranega pristopa)' iz oddelka 1, točka (b), Priloge V. Za poročanje datumov se uporablja dogovor 'dd/mm/llll'.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0060	Vsa cenovna tveganja (APR)	Člen 377 Uredbe (EU) št. 575/2013	Poročajo se rezultati, dobljeni z uporabo regulativnega modela za trgovanje s korelacijo pri vsakem portfelju. Številčni podatki se poročajo za vsak datum iz stolpca 0010. Celica se pusti prazna, kadar institucija ne uporablja modela za trgovanje s korelacijo na datum iz stolpca 0010 (tj. vrednost nič se poroča samo, kadar je rezultat izračuna enak nič).

C 120.01 – SBM. OBČUTLJIVOSTI NA TVEGANJA PO INSTRUMENTU/PORTFELJU

Institucije za vsak instrument poročajo občutljivosti na dejavnike tveganja, ki jim je izpostavljen instrument. Poroča se ena vrstica na dejavnik tveganja/občutljivost. V posameznih vrsticah se poroča neto pozicija za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzgor za ta dejavnik tveganja (CVRk+) ali neto pozicija za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzdol za ta dejavnik tveganja (CVRk-), kot je določeno v členu 325g Uredbe (EU) št. 575/2013. Vse vrednosti se nanašajo na „končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa)“ (kot je določen v oddelku 1, točka (b)(v), Priloge V k tej uredbi). Institucije samo enkrat poročajo vsako kombinacijo portfelja, številke instrumenta (stolpec 0010), identifikatorja tveganja (stolpec 0020), skupine (stolpec 0030) in dodatnega identifikatorja (stolpec 0040).

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Številka instrumenta	Oddelek 2 Priloge V	Poroča se številka instrumenta iz Priloge V.
0020	Identifikator dejavnika tveganja	Členi 325l, 325m, 325n, 325o, 325p, 325q Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se identifikator dejavnika tveganja, kot je določen v razpredelnici na koncu te priloge.
0030	Skupina	Člen 325d(3) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se skupina; kadar identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0020, ustreza razredu tveganja: — splošno obrestno tveganje, je odgovor ime valute zadevnega dejavnika tveganja netvegane obrestne mere, inflacije ali medvalutnega tveganja osnove (na podlagi oznake valute po ISO 4217, npr. „EUR“),

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			— tveganje kreditnega razmika za nelistinjenje, je odgovor številka skupine iz člena 325ah(1), razpredelnica 4, Uredbe (EU) št. 575/2013, — tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki ni vključeno v alternativni trgovni portfelj s korelacijo, je odgovor številka skupine iz člena 325am(1), razpredelnica 7, navedene uredbe, — tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki je vključeno v alternativni trgovni portfelj s korelacijo, je odgovor številka skupine iz člena 325ak, razpredelnica 6, navedene uredbe, — tveganje lastniških finančnih instrumentov, je odgovor številka skupine iz člena 325ap(1), razpredelnica 8, navedene uredbe, — blagovno tveganje, je odgovor številka skupine iz člena 325as, razpredelnica 9, navedene uredbe, — valutno tveganje in sestavini delta ali ukrivljenost, je odgovor ime valute (npr. 'USD'; poročane kode valute ustrezajo oznaki valute po ISO 4217), — valutno tveganje in sestavina delta, je odgovor ime valutnega para (npr. 'EUR_USD'; poročane kode valute ustrezajo oznaki valute po ISO 4217).
0040	Dodatni identifikator 1	Členi 325l do 325q in 325ai Uredbe (EU) št. 575/2013	Poročajo se naslednje informacije o razlikovanju dejavnika tveganja na ravni znotraj skupin. Kadar identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0020, ustreza razredu tveganja: — splošno obrestno tveganje in sestavina delta, je odgovor ime krivulje netvegane obrestne mere ali drugega ustreznega edinstvenega identifikatorja, — tveganje kreditnega razmika za nelistinjenje ali razred tveganja kreditnega razmika za listinjenje, ki je vključeno v alternativni trgovni portfelj s korelacijo (ACTP CSR), je odgovor LEI izdajatelja in je identičen za kateri koli dve poročani občutljivosti na dva dejavnika tveganja, kjer je korelacijski parameter $\rho_{ki}^{(name)}$ enak 1 v skladu s členom 325ai(1) Uredbe (EU) št. 575/2013, — tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki ni vključeno v alternativni trgovni portfelj s korelacijo, je odgovor ime tranše ali drug ustrezen edinstveni identifikator,

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			— tveganje lastniških vrednostnih papirjev, je odgovor koda ISIN osnovnega instrumenta, — blagovno tveganje, je odgovor ime blaga ali drug ustrezeni edinstveni identifikator. Kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov, institucije poročajo določeno vrednost (NULL) kot nerelevantno.
0060	Občutljivost na tveganje (rezultati v valuti poročanja)	Člen 325d(2) in členi 325g, 325r, 325s, 325 t in 325ax Uredbe (EU) št. 575/2013	Občutljivosti na tveganja (občutljivosti delta/vega in pozicije tveganja ukrivljenosti) se poročajo na ravni vsakega instrumenta za vse relevantne dejavnike tveganja iz stolpcev 0020 do 0040. Vrednosti se poročajo v valuti poročanja institucije. Kadar identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0020, ustreza: — sestavini delta tveganja metode na podlagi občutljivosti, se poroča neto občutljivost na dejavnik tveganja (S_k), kot je določeno v členu 325r Uredbe (EU) št. 575/2013. Če so institucije pridobile dovoljenje svojega pristojnega organa za uporabo alternativnih izračunov občutljivosti na delta tveganje v skladu s členom 325t(5) navedene uredbe, se za poročanje sklicujejo na te alternativne opredelitve; — sestavini vega tveganja metode na podlagi občutljivosti, se poroča občutljivost na vega tveganje opcije na dani dejavnik tveganja (S_k), kot je določeno v členu 325s Uredbe (EU) št. 575/2013. Če so institucije pridobile dovoljenje svojega pristojnega organa za uporabo alternativnih izračunov občutljivosti na vega tveganje v skladu s členom 325t(6) navedene uredbe, se za poročanje sklicujejo na te alternativne izračune. Ne glede na to, ali institucija uporablja izračun iz člena 325s ali alternativni izračun v skladu s členom 325t(6) navedene uredbe, se občutljivost poroča po tehtanju z ustrezno implicitno nestanovitnostjo; — sestavini tveganja ukrivljenosti metode na podlagi občutljivosti, se poroča neto pozicija za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzgor za ta dejavnik tveganja (CVR_k^+) ali neto pozicija za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzdol za ta dejavnik tveganja (CVR_k^-), kot je določeno v členu 325g Uredbe (EU) št. 575/2013. Poročana vrednost se izrazi z decimalnim številom na vsaj dve decimalni mesti natančno. Vrednost nič se poroča samo, kadar je rezultat izračuna res nič.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0070	Valuta poročanja		Poroča se ime valute poročanja institucije (poročane vrednosti ustrezajo oznaki valute po ISO 4217, npr. ‚EUR‘).
0080	Občutljivost na tveganje (rezultati v valuti portfelja EBA)	Oddelka 3 in 4 Priloge V k tej uredbi in člen 325d(2) ter členi 325g, 325r, 325s, 325 t in 325ax Uredbe (EU) št. 575/2013	Vrednosti se poročajo v skladu z navodili za stolpec 0060, vendar se pretvorijo po promptnem menjalnem tečaju ECB, povezanem z valuto portfelja, kot je določena v oddelkih 3 in 4 Priloge V k tej uredbi.
0090	Utež tveganja	Del 3, naslov IV, poglavje 1a, oddelek 6, Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se utež tveganja, ki ustreza dejavniku tveganja, kot je določen v stolpcih 0020 do 0040. Če identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0020, ustreza sestavini tveganja ukrivljenosti, se poroča utež tveganja, uporabljena za določitev ustreznega relativnega premika. Poročana vrednost se izrazi z decimalnim številom na vsaj štiri decimalna mesta natančno.
0110	Dodatni identifikator 2	Člen 325p(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Če identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0010, ustreza razredu tveganja ‚blagovno tveganje in sestavina delta tveganja‘ metode na podlagi občutljivosti, je odgovor sklop pravnih pogojev v zvezi z lokacijo izročitve blaga ali drug ustrezeni edinstveni identifikator. Kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov, institucije poročajo določeno vrednost (NULL) kot nerelevantno.
0120	Kategorija kreditne kakovosti	Člen 325m(1) in člen 325ah(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	Če identifikator dejavnika tveganja, izbran v stolpcu 0010, ustreza razredu tveganja ‚tveganje kreditnega razmika za nelistinjenje in sestavina delta tveganja‘ metode na podlagi občutljivosti, je odgovor eno od naslednjega: (a) ‚CQS 1‘; (b) ‚CQS 2‘; (c) ‚CQS 3‘; (d) ‚CQS 4‘; (e) ‚CQS 5‘; (f) ‚CQS 6‘; (g) ‚CQS ni dodeljena (brez bonitetne ocene)‘. Kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov, institucije poročajo določeno vrednost (NULL) kot nerelevantno.

C 120.02 – SBM. SESTAVA KAPITALSKIH ZAHTEV PO PORTFELJIH

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Razred tveganja	Člen 325d(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se razred tveganja. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) ‚splošno obrestno tveganje (GIRR)‘, (b) ‚tveganje kreditnega razmika: tveganje kreditnega razmika za nelistinjenje‘, (c) ‚tveganje kreditnega razmika: tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki ni vključeno v alternativni trgovni portfelj s korelacijo‘, (d) ‚tveganje kreditnega razmika: tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki je vključeno v alternativni trgovni portfelj s korelacijo‘, (e) ‚tveganje lastniških finančnih instrumentov‘, (f) ‚blagovno tveganje‘, (g) ‚valutno tveganje‘.
0020	Sestavina	Člen 325e(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se sestavina metode na podlagi občutljivosti. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) ‚delta tveganje‘, (b) ‚vega tveganje‘, (c) ‚tveganje ukrivljenosti‘.
0030	Scenarij korelacije	Člen 325h Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se scenarij korelacije. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) ‚scenarij srednjih korelacij‘, (b) ‚scenarij visokih korelacij‘, (c) ‚scenarij nizkih korelacij‘.
0040	Kapitalske zahteve (rezultati v valuti poročanja)	Člen 325h Uredbe (EU) št. 575/2013	Vrednosti kapitalskih zahtev se poročajo za ‚končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa)‘ (kot je določen v oddelku 1, točka (b), Priloga V k tej uredbi) za vsak portfelj za vse ustrezne kombinacije razreda tveganja, sestavine in scenarija korelacije. Vrednosti se poročajo v valuti poročanja institucije in so izražene na vsaj na dve decimalni mesti natančno.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0050	Valuta poročanja		Poroča se valuta poročanja institucije (poročana vrednost ustreza oznaki valute po ISO 4217).
0060	Kapitalske zahteve (rezultati v valuti portfelja EBA)	Oddelka 3 in 4 Priloge V k tej uredbi ter člen 325h Uredbe (EU) št. 575/2013	Vrednosti se poročajo v skladu z navodili za stolpec 0040, vendar se pretvorijo po promptnem menjalnem tečaju ECB, povezanem z valuto portfelja, kot je določena v oddelkih 3 in 4 Priloge V k tej uredbi.
0070	Pozicije brez izbirnosti, za katere se uporabljajo kapitalske zahteve za tveganje ukrivljenosti	Člen 325e(3) Uredbe (EU) št. 575/2013	Če sestavina v stolpcu 0020 ustreza tveganju ukrivljenosti: (a) se poroča ‚DA‘, če institucija pri izračunu rezultata, ki se poroča v stolpcih 0040 in 0060, uporablja pristop iz člena 325e(3), prvi pododstavek, Uredbe (EU) št. 575/2013; (b) v nasprotnem primeru se poroča ‚NE‘. ‚NE‘ se poroča tudi, kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov.
0080	Pristop osnovne valute, ki se uporablja za delta valutno tveganje in valutno tveganje ukrivljenosti	Člen 325q(7) Uredbe (EU) št. 575/2013	Če razred tveganja v stolpcu 0010 ustreza valutnemu tveganju in sestavina v stolpcu 0020 ustreza delta tveganju ali tveganju ukrivljenosti: (a) se poroča ‚DA‘, če institucija pri izračunu rezultata, ki se poroča v stolpcih 0040 in 0060, uporablja pristop iz člena 325q(7) Uredbe (EU) št. 575/2013; (b) v nasprotnem primeru se poroča ‚NE‘. ‚NE‘ se poroča tudi, kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov.
0090	Deljenje sestavin tveganja ukrivljenosti za valutno tveganje s skalarjem	Člen 325q(6) Uredbe (EU) št. 575/2013	Če razred tveganja v stolpcu 0010 ustreza valutnemu tveganju in sestavina v stolpcu 0020 ustreza tveganju ukrivljenosti: (a) se poroča ‚DA‘, če institucija pri izračunu rezultata, ki se poroča v stolpcih 0040 in 0060, uporablja pristop iz člena 325q(6) Uredbe (EU) št. 575/2013; (b) v nasprotnem primeru se poroča ‚NE‘. ‚NE‘ se poroča tudi, kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov.
0100	Polje za prosto besedilo		Institucija lahko v tem stolpcu navede dodatne informacije.

C 120.04 – DRC. TRŽNE VREDNOSTI IN BRUTO ZNESKI SKOKOVITEGA NARAŠČANJA VERJETNOSTI NEPLAČILA (JTD) PO INSTRUMENTIH/PORTFELJIH

Institucije poročajo izpostavljenosti, ki ustrezajo instrumentu, za vsak instrument posebej. Poroča se ena vrstica na izpostavljenost. Vse vrednosti se nanašajo na „končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa)“ (kot je določen v oddelku 1, točka (b)(v), Priloge V k tej uredbi). Izpostavljenosti se poročajo pred vsakršnim pobotom, vendar po replikaciji ali razstavljanju (kot sta opredeljena v členih 325z in 325ac Uredbe (EU) št. 575/2013), kadar je ustrezno.

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Številka instrumenta	Oddelke 2 Priloge V	Poroča se številka instrumenta iz Priloge V.
0020	Razred tveganja	Člen 325v(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se razred tveganja, za katerega se v stolpcih 0030 in 0040 poroča zahteva za tveganje neplačila (DRC). Odgovor je ena izmed naslednjih vrst instrumentov: (a) „instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju“; (b) „pozicije v listinjenju, ki niso vključene v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“; (c) „pozicije v listinjenju, ki so vključene v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“.
0030	Skupina 1	Člen 325y(3), člen 325aa(4) in člen 325ad(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se skupina. Če razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0020, ustreza možnosti „nelistinjenja“, je odgovor eno od naslednjega: (a) „podjetja“, (b) „države“, (c) „lokalne oblasti/občine“. Če namesto tega razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0020, ustreza možnosti „listinjenja, ki niso vključena v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“, je odgovor eno od naslednjega: (d) „ABCP – Azija“, (e) „ABCP – Evropa“, (f) „ABCP – Severna Amerika“, (g) „ABCP – preostali svet“, (h) „kreditni za nakup vozil/zakup vozil – Azija“, (i) „kreditni za nakup vozil/zakup vozil – Evropa“, (j) „kreditni za nakup vozil/zakup vozil – Severna Amerika“.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			(k) ,kreditni za nakup vozil/zakup vozil – preostali svet’, (l) ,relistinjeni finančni instrumenti, zavarovani z zastavo dolžniških instrumentov (<i>CDO-squared</i>) – Azija’, (m) ,relistinjeni finančni instrumenti, zavarovani z zastavo dolžniških instrumentov (<i>CDO-squared</i>) – Evropa’, (n) ,relistinjeni finančni instrumenti, zavarovani z zastavo dolžniških instrumentov (<i>CDO-squared</i>) – Severna Amerika’, (o) ,relistinjeni finančni instrumenti, zavarovani z zastavo dolžniških instrumentov (<i>CDO-squared</i>) – preostali svet’, (p) ,finančni instrumenti, zavarovani z zastavo posojila – Azija’, (q) ,finančni instrumenti, zavarovani z zastavo posojila – Evropa’, (r) ,finančni instrumenti, zavarovani z zastavo posojila – Severna Amerika’, (s) ,finančni instrumenti, zavarovani z zastavo posojila – preostali svet’, (t) ,finančni instrumenti, zavarovani s hipoteko na poslovne nepremičnine (CMBS) – Azija’, (u) ,finančni instrumenti, zavarovani s hipoteko na poslovne nepremičnine (CMBS) – Evropa’, (v) ,finančni instrumenti, zavarovani s hipoteko na poslovne nepremičnine (CMBS) – Severna Amerika’, (w) ,finančni instrumenti, zavarovani s hipoteko na poslovne nepremičnine (CMBS) – preostali svet’, (x) ,kreditne kartice – Azija’, (y) ,kreditne kartice – Evropa’, (z) ,kreditne kartice – Severna Amerika’, (aa) ,kreditne kartice – preostali svet’, (bb) ,drugi krediti na drobno – Azija’, (cc) ,drugi krediti na drobno – Evropa’, (dd) ,drugi krediti na drobno – Severna Amerika’, (ee) ,drugi krediti na drobno – preostali svet’, (ff) ,drugi krediti velikim institucionalnim strankam – Azija’, (gg) ,drugi krediti velikim institucionalnim strankam – Evropa’, (hh) ,drugi krediti velikim institucionalnim strankam – Severna Amerika’, (ii) ,drugi krediti velikim institucionalnim strankam – preostali svet’, (jj) ,finančni instrumenti, zavarovani s stanovanjsko hipoteko (RMBS) – Azija’, (kk) ,finančni instrumenti, zavarovani s stanovanjsko hipoteko (RMBS) – Evropa’, (ll) ,finančni instrumenti, zavarovani s stanovanjsko hipoteko (RMBS) – Severna Amerika’, (mm) ,finančni instrumenti, zavarovani s stanovanjsko hipoteko (RMBS) – preostali svet’, (nn) ,mala in srednja podjetja (MSP) – Azija’, (oo) ,mala in srednja podjetja (MSP) – Evropa’, (pp) ,mala in srednja podjetja (MSP) – Severna Amerika’,

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			(qq) „mala in srednja podjetja (MSP) – preostali svet“, (rr) „študentska posojila– Azija“, (ss) „študentska posojila– Evropa“, (tt) „študentska posojila – Severna Amerika“, (uu) „študentska posojila – preostali svet“. Če namesto tega razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0020, ustreza možnosti „listinjenja, ki so vključena v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“, je odgovor „listinjenja, ki so vključena v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“.
0040	Skupina2	Člen 325ad(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Če razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0020, ustreza možnosti „listinjenja, ki so vključena v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“, je odgovor ime indeksa, sicer se poroča (NULL).
0050	Dolžnik	Člen 325v(2), člen 325x(1), člen 325z in člen 325ac Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucije poročajo informacije v zvezi z dolžnikom. Kadar identifikator razreda tveganja, poročan v stolpcu 0020, ustreza: — „instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju“, je odgovor LEI dolžnika; — „pozicije v listinjenju, ki niso vključene v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“, je odgovor ime dolžnika ali edinstveni identifikator, ki označuje skupino osnovnih sredstev in tranšo; — „pozicije v listinjenju, ki so vključene v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“, je odgovor edinstveni identifikator, ki označuje družino, serijo in tranšo indeksa.
0060	Kategorija kreditne kakovosti	Člen 325y(1) in (2), člen 325aa(1) in člen 325ad(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucije poročajo kreditno kakovost. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) „CQS 1“, (b) „CQS 2“, (c) „CQS 3“, (d) „CQS 4“, (e) „CQS 5“, (f) „CQS 6“, (g) „CQS ni dodeljena (brez bonitetne ocene)“, (h) „CQS ni dodeljena (neplačano)“, (i) „CQS ni dodeljena (0 % utež tveganja)“. Če razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0020, ustreza možnosti „listinjenja, ki so vključena v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“, ali „listinjenja, ki niso vključena v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“ je odgovor ena od zgornjih možnosti ali eno od naslednjega: (j) „CQS 7“, (k) „CQS 8“,

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			(l) ‚CQS 9‘, (m) ‚CQS 10‘, (n) ‚CQS 11‘, (o) ‚CQS 12‘, (p) ‚CQS 13‘, (q) ‚CQS 14‘, (r) ‚CQS 15‘, (s) ‚CQS 16‘, (t) ‚CQS 17‘, (u) ‚CQS vse drugo‘.
0070	Utež tveganja neplačila	Člen 325v(1), točka (f), člen 325y(1) in (2), člen 325aa(1) in člen 325ad(1) Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucije poročajo ustrezno utež tveganja. Uteži tveganja, ki se uporabljajo za izpostavljenosti iz naslova listinjenja, se poročajo po množenju z 8 % v skladu s členom 325aa(1) Uredbe (EU) št. 575/2013.
0080	Prednost	Člen 325w(3) in (6) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se prednost izpostavljenosti. Če razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0020, ustreza možnosti ‚instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju‘ ali ‚pozicije v listinjenju, ki niso vključene v alternativni trgovni portfelj s korelacijo‘ je odgovor eno od naslednjega: (a) ‚lastniški finančni instrumenti‘, (b) ‚neprednostni dolžniški instrumenti‘, (c) ‚prednostni dolžniški instrumenti‘, (d) ‚krite obveznice‘. Celica se pusti prazna, kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov.
0090	Zapadlost	Členi 325x, 325z in 325ac Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se datum zapadlosti izpostavljenosti. Za poročanje datumov se uporablja dogovor ‚dd/mm/llll‘.
0100	Stopnja poplačljivosti	Člen 325v(1), točka (e), Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucije poročajo stopnjo poplačljivosti. Stopnja poplačljivosti se izračuna z uporabo veljavne izgube ob neplačilu (LGD) kot stopnje poplačljivosti = 1 – LGD. Poročana stopnja poplačljivosti se izrazi kot decimalno število med 0 in 1, na vsaj štiri decimalna mesta natančno.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0110	Usmerjenost	Člen 325a(1), točki (a) in (b), Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucije poročajo usmerjenost izpostavljenosti v skladu z opredelitvami pojmov iz člena 325v(1), točki (a) in (b), Uredbe (EU) št. 575/2013. Odgovor je eden izmed naslednjih: (a) ‚kratka izpostavljenost‘, (b) ‚dolga izpostavljenost‘.
0120	Točka vključitve (%)	Člena 325aa in 325ad Uredbe (EU) št. 575/2013	Kadar se poročana izpostavljenost nanaša na tranšo, institucije poročajo točko vključitve tranše. Poročana vrednost se izrazi z decimalnim številom na vsaj štiri decimalna mesta natančno.
0130	Točka izločitve (%)	Člena 325aa in 325ad Uredbe (EU) št. 575/2013	Kadar se poročana izpostavljenost nanaša na tranšo, institucije poročajo točko izključitve tranše. Poročana vrednost se izrazi z decimalnim številom na vsaj štiri decimalna mesta natančno.
0140–0170	Rezultati v valuti poročanja		Vrednosti se poročajo v valuti poročanja institucije in so izražene na vsaj na štiri decimalna mesta natančno, kjer je ustrezno.
0140	Hipotetični znesek	Člen 325w(1), (2) in (5) Uredbe (EU) št. 575/2013	Kadar razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0020, ustreza možnosti ‚instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju‘, institucije poročajo hipotetični znesek instrumenta. Vrednost ustreza V_{notional} iz člena 325w(1) in (2) Uredbe (EU) št. 575/2013 ali V iz člena 325w(5) navedene uredbe, odvisno od vrste izpostavljenosti. Celica se pusti prazna, kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov ali kadar institucija izrecno ne izračuna ali uporabi zneska, ki ga je treba poročati v tem stolpcu, da bi ocenila bruto znesek skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila.
0150	Poslovni izid + prilagoditev (P&L + Adjustment)	Člen 325w(1), (2) in (5) Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucije poročajo vsoto poslovnega izida ter prilagoditve za vsako izpostavljenost: — če razred tveganja, poročan v stolpcu 0020, ustreza možnosti ‚instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju‘ in je poročana izpostavljenost dolga, institucije poročajo vsoto poslovnega izida $P\&L_{\text{long}}$ in prilagoditve $\text{Adjustment}_{\text{long}}$ v skladu s členom 325w(1) Uredbe (EU) št. 575/2013;

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			— če razred tveganja, poročan v stolpcu 0020, ustreza možnosti ,instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju‘ in je poročana izpostavljenost kratka, institucije poročajo vsoto poslovnega izida $P\&L_{short}$ in prilagoditve $Adjustment_{short}$ v skladu s členom 325w(2) navedene uredbe; Celica se pusti prazna, kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov ali kadar institucija izrecno ne izračuna ali uporabi zneska, ki ga je treba poročati v tem stolpcu, da bi ocenila bruto znesek skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila.
0160	Bruto znesek skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila	Člen 325v(1), točka (c), člen 325w(1), (2) in (5), člen 325z(1) in člen 325ac(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucije poročajo bruto znesek skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila za posamezno izpostavljenost.
0170	Valuta		Poroča se valuta poročanja institucije (poročana vrednost ustreza oznaki valute po ISO 4217).
0180–0200	Rezultati v valuti portfelja EBA	Oddelka 3 in 4 Priloge V k tej uredbi ter členi 325y, 325aa in 325ad Uredbe (EU) št. 575/2013	Vrednosti se poročajo v skladu z navodili za stolpec 0030, vendar se pretvorijo po promptnem menjalnem tečaju ECB, povezanem z valuto portfelja, kot je določena v oddelkih 3 in 4 Priloge V k tej uredbi.
0180	Hipotetični znesek	Člen 325w(1), (2) in (5) Uredbe (EU) št. 575/2013	Kadar razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0020, ustreza možnosti ,instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju‘, institucije poročajo hipotetični znesek instrumenta. Vrednost ustreza $V_{notional}$ iz člena 325w(1) in (2) Uredbe (EU) št. 575/2013 ali V iz člena 325w(5) navedene uredbe, odvisno od vrste izpostavljenosti. Celica se pusti prazna, kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov ali kadar institucija izrecno ne izračuna ali uporabi zneska, ki ga je treba poročati v tem stolpcu, da bi ocenila bruto znesek skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila.
0190	Poslovni izid + prilagoditev (P&L + Adjustment)	Člen 325w(1), (2) in (5) Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucije poročajo vsoto poslovnega izida ter prilagoditve za vsako izpostavljenost: — če razred tveganja, poročan v stolpcu 0020, ustreza možnosti ,instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju‘ in je poročana izpostavljenost dolga, institucije poročajo vsoto poslovnega izida $P\&L_{long}$ in prilagoditve $Adjustment_{long}$ v skladu s členom 325w(1) Uredbe (EU) št. 575/2013;

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			— če razred tveganja, poročan v stolpcu 0020, ustreza možnosti ,instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju' in je poročana izpostavljenost kratka, institucije poročajo vsoto poslovnega izida P&L _{short} in prilagoditve Adjustment _{short} v skladu s členom 325w(2) navedene uredbe; Celica se pusti prazna, kadar ne gre za nobenega od navedenih primerov ali kadar institucija izrecno ne izračuna ali uporabi zneska, ki ga je treba poročati v tem stolpcu, da bi ocenila bruto znesek skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila.
0200	Bruto znesek skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila	Člen 325v(1), točka (c), člen 325w(1), (2) in (5), člen 325z(1) in člen 325ac(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Institucije poročajo bruto znesek skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila za posamezno izpostavljenost.

C 120.05 – DRC. SESTAVA KAPITALSKIH ZAHTEV PO PORTFELJIH

Navodila v zvezi z delovnimi listi (os z)

Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
Portfelj	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V.

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Razred tveganja	Člen 325v(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se razred tveganja, za katerega se v stolpcih 0030 in 0040 poroča zahteva za tveganje neplačila. Odgovor je ena izmed naslednjih vrst instrumentov: (a) ,instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju', (b) ,pozicije v listinjenju, ki niso vključene v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo', (c) ,pozicije v listinjenju, ki so vključene v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo'.
0020	Skupina 1	Člen 325y(3), člen 325aa(4) in člen 325ad(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Poroča se skupina. Če razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0010, ustreza možnosti ,instrumenti, ki niso pozicije v listinjenju', je odgovor eno od naslednjega: (a) ,podjetja', (b) ,države',

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			(c) „lokalne oblasti/občine“. Če namesto tega razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0010, ustreza možnosti „pozicije v listinjenju, ki niso vključene v alternativni trgovni portfelj s korelacijo“, je odgovor eno od naslednjega: (d) „ABCP – Azija“, (e) „ABCP – Evropa“, (f) „ABCP – Severna Amerika“, (g) „ABCP – preostali svet“, (h) „kreditni za nakup vozil/zakup vozil – Azija“, (i) „kreditni za nakup vozil/zakup vozil – Evropa“, (j) „kreditni za nakup vozil/zakup vozil – Severna Amerika“, (k) „kreditni za nakup vozil/zakup vozil – preostali svet“, (l) „relistinjeni finančni instrumenti, zavarovani z zastavo dolžniških instrumentov (CDO-squared) – Azija“, (m) „relistinjeni finančni instrumenti, zavarovani z zastavo dolžniških instrumentov (CDO-squared) – Evropa“, (n) „relistinjeni finančni instrumenti, zavarovani z zastavo dolžniških instrumentov (CDO-squared) – Severna Amerika“, (o) „relistinjeni finančni instrumenti, zavarovani z zastavo dolžniških instrumentov (CDO-squared) – preostali svet“, (p) „finančni instrumenti, zavarovani z zastavo posojila – Azija“, (q) „finančni instrumenti, zavarovani z zastavo posojila – Evropa“, (r) „finančni instrumenti, zavarovani z zastavo posojila – Severna Amerika“, (s) „finančni instrumenti, zavarovani z zastavo posojila – preostali svet“, (t) „finančni instrumenti, zavarovani s hipoteko na poslovne nepremičnine (CMBS) – Azija“, (u) „finančni instrumenti, zavarovani s hipoteko na poslovne nepremičnine (CMBS) – Evropa“, (v) „finančni instrumenti, zavarovani s hipoteko na poslovne nepremičnine (CMBS) – Severna Amerika“, (w) „finančni instrumenti, zavarovani s hipoteko na poslovne nepremičnine (CMBS) – preostali svet“, (x) „kreditne kartice – Azija“, (y) „kreditne kartice – Evropa“, (z) „kreditne kartice – Severna Amerika“, (aa) „kreditne kartice – preostali svet“, (bb) „drugi krediti na drobno – Azija“, (cc) „drugi krediti na drobno – Evropa“, (dd) „drugi krediti na drobno – Severna Amerika“, (ee) „drugi krediti na drobno – preostali svet“, (ff) „drugi krediti velikim institucionalnim strankam – Azija“, (gg) „drugi krediti velikim institucionalnim strankam – Evropa“, (hh) „drugi krediti velikim institucionalnim strankam – Severna Amerika“,

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
			(ii) ,drugi krediti velikim institucionalnim strankam – preostali svet‘, (jj) ,finančni instrumenti, zavarovani s stanovanjsko hipoteko (RMBS) – Azija‘, (kk) ,finančni instrumenti, zavarovani s stanovanjsko hipoteko (RMBS) – Evropa‘, (ll) ,finančni instrumenti, zavarovani s stanovanjsko hipoteko (RMBS) – Severna Amerika‘, (mm) ,finančni instrumenti, zavarovani s stanovanjsko hipoteko (RMBS) – preostali svet‘, (nn) ,mala in srednja podjetja (MSP) – Azija‘, (oo) ,mala in srednja podjetja (MSP) – Evropa‘, (pp) ,mala in srednja podjetja (MSP) – Severna Amerika‘, (qq) ,mala in srednja podjetja (MSP) – preostali svet‘, (rr) ,študentska posojila– Azija‘, (ss) ,študentska posojila– Evropa‘, (tt) ,študentska posojila – Severna Amerika‘, (uu) ,študentska posojila – preostali svet‘. Če namesto tega razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0010, ustreza možnosti ,pozicije v listinjenju, ki so vključene v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo‘, je odgovor ,listinjenja, ki so vključena v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo‘.
0030	Skupina2	Člen 325ad(2) Uredbe (EU) št. 575/2013	Če razred tveganja, ki se poroča v stolpcu 0010, ustreza možnosti ,pozicije v listinjenju, ki so vključene v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo‘, je odgovor ime indeksa, sicer se poroča (NULL).
0040	Kapitalske zahteve (rezultati v valuti poročanja)	Členi 325y, 325aa in 325ad Uredbe (EU) št. 575/2013	Kapitalske zahteve za tveganje neplačila se poročajo na ,končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa)‘ (kot je določen v oddelku 1, točka (b), Priloge V k tej uredbi). Vrednosti se poročajo v valuti poročanja institucije in so izražene na vsaj na dve decimalni mesti natančno.
0050	Valuta poročanja		Poroča se valuta poročanja institucije (poročana vrednost ustreza oznaki valute po ISO 4217).
0060	Kapitalske zahteve (rezultati v valuti portfelja EBA)	Oddelka 3 in 4 Priloge V k tej uredbi ter členi 325y, 325aa in 325ad Uredbe (EU) št. 575/2013	Vrednosti se poročajo v skladu z navodili za stolpec 0030, vendar se pretvorijo po promptnem menjalnem tečaju ECB, povezanem z valuto portfelja, kot je določena v oddelkih 3 in 4 Priloge V k tej uredbi.

C 120.06 – ASA. KAPITALSKE ZAHTEVE

Stolpec	Oznaka	Pravna podlaga	Navodila
0010	Številka portfelja	Oddelki 3, 4 in 5 Priloge V	Poroča se številka portfelja iz Priloge V.
0020–0040	Rezultati v valuti poročanja	Oddelka 3 in 4 Priloge V	
0020	Kapitalske zahteve za metodo na podlagi občutljivosti	Člen 325h Uredbe (EU) št. 575/2013	Kapitalske zahteve po metodi na podlagi občutljivosti v skladu z alternativnim standardiziranim pristopom se poročajo za „končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa)“ (kot je določen v oddelku 1, točka (b), Priloge V k tej uredbi) za vsak portfelj.
0030	Kapitalske zahteve za tveganje neplačila	Člen 325v Uredbe (EU) št. 575/2013	Kapitalske zahteve za tveganje neplačila v skladu z alternativnim standardiziranim pristopom se poročajo za „končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa)“ (kot je določen v oddelku 1, točka (b), Priloge V k tej uredbi) za vsak portfelj.
0040	Kapitalske zahteve za pribitek za preostala tveganja	Člen 325u Uredbe (EU) št. 575/2013	Kapitalske zahteve za pribitek za preostala tveganja v skladu z alternativnim standardiziranim pristopom se poročajo za „končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa)“ (kot je določen v oddelku 1, točka (b), Priloge V k tej uredbi) za vsak portfelj.
0050–0070	Rezultati v valuti portfelja EBA	Oddelka 3 in 4 Priloge V	Če se valuta poročanja institucije razlikuje od valut portfelja EBA, določenih v oddelkih 3 in 4, Priloge V k tej uredbi, institucije pretvorijo valuto poročanja po veljavnem promptnem menjalnem tečaju ECB.
0050	Kapitalske zahteve za metodo na podlagi občutljivosti	Člen 325h Uredbe (EU) št. 575/2013	Kapitalske zahteve po metodi na podlagi občutljivosti v skladu z alternativnim standardiziranim pristopom se poročajo za „končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa)“ (kot je določen v oddelku 1, točka (b), Priloge V k tej uredbi) za vsak portfelj.
0060	Kapitalske zahteve za tveganje neplačila	Člen 325v Uredbe (EU) št. 575/2013	Kapitalske zahteve za tveganje neplačila v skladu z alternativnim standardiziranim pristopom se poročajo za „končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa)“ (kot je določen v oddelku 1, točka (b), Priloge V k tej uredbi) za vsak portfelj.
0070	Kapitalske zahteve za pribitek za preostala tveganja	Člen 325u Uredbe (EU) št. 575/2013	Kapitalske zahteve za pribitek za preostala tveganja v skladu z alternativnim standardiziranim pristopom se poročajo za „končni referenčni datum mer tveganja (in končni referenčni datum alternativnega standardiziranega pristopa)“ (kot je določen v oddelku 1, točka (b), Priloge V k tej uredbi) za vsak portfelj.

Tabela: smernice za poročanje predlog 106.01 (stolpec 0010) in 120.01 (stolpec 0020)

- Stolpec ‚razred tveganja‘ se nanaša na člen 325d(1) Uredbe (EU) št. 575/2013. Za označevanje razredov tveganja se uporabljajo naslednje kratice:
 - (a) ‚GIRR‘ (splošno obrestno tveganje);
 - (b) ‚CSR_NON_SEC‘ (tveganje kreditnega razmika za nelistinjenje);
 - (c) ‚CSR_SEC_NON_ACTP‘ (tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki ni vključeno v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo);
 - (d) ‚CSR_SEC_ACTP‘ (tveganje kreditnega razmika za listinjenje, ki je vključeno v alternativni trgovalni portfelj s korelacijo);
 - (e) ‚EQ‘ (tveganje lastniških finančnih instrumentov);
 - (f) ‚CM‘ (blagovno tveganje);
 - (g) ‚FX‘ (valutno tveganje).
- Stolpec ‚sestavina‘ se nanaša na člen 325e(1) Uredbe (EU) št. 575/2013. Za označevanje sestavin metode na podlagi občutljivosti se uporabljajo naslednje kratice:
 - (a) ‚DELTA‘ (delta tveganje);
 - (b) ‚VEGA‘ (vega tveganje);
 - (c) ‚CURVATURE‘ (tveganje ukrivljenosti).
- Stolpec ‚zapadlost‘ se nanaša na zapadlost dejavnika tveganja, pri čemer so dejavniki tveganja opredeljeni s pomočjo določenih točk v skladu s členi 325l, 325m, 325n, 325o, 325p in 325q Uredbe (EU) št. 575/2013. Za dejavnike vega splošnega obrestnega tveganja, kot so določeni v členu 325l(7) navedene uredbe, se navedeta dve zapadlosti, ločeni z vezajem (npr. ‚0,5 leta – 0,5 leta‘), pri čemer se prva nanaša na zapadlost opcije, druga pa na preostalo zapadlost osnovnega instrumenta opcije na datum izteka opcije.
- V stolpcu ‚dodatne specifikacije‘ so nadalje določeni ustrezni dejavniki tveganja v zvezi z razlikovanjem med dejavniki tveganja inflacije in dejavniki medvalutnega tveganja osnove v skladu s členom 325l Uredbe (EU) št. 575/2013, razlikovanjem med dejavniki tveganja, ki se nanašajo na dolžniške instrumente, in dejavniki tveganja, ki se nanašajo na kreditne zamenjave v skladu s členoma 325m in 325n navedene uredbe, razlikovanjem med dejavniki tveganja promptne cene lastniških finančnih instrumentov in cene repo poslov z lastniškimi finančnimi instrumenti v skladu s členom 325o navedene uredbe ter razlikovanjem med neto pozicijo za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzgor za ta dejavnik tveganja (CVRk+) ali neto pozicijo za tveganje ukrivljenosti ob spremembi navzdol za ta dejavnik tveganja (CVRk-), kot je določeno v členu 325g navedene uredbe.

Razred tveganja	Sestavina	Zapadlost	Dodatne specifikacije	Identifikator dejavnika tveganja	Pravna podlaga
CM	DELTA	0 let		CM_D_00.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	DELTA	0,25 leta		CM_D_00.25	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	DELTA	0,5 leta		CM_D_00.50	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	DELTA	1 leto		CM_D_01.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	DELTA	2 leti		CM_D_02.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	DELTA	3 leta		CM_D_03.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	DELTA	5 let		CM_D_05.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	DELTA	10 let		CM_D_10.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	DELTA	15 let		CM_D_15.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	DELTA	20 let		CM_D_20.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	DELTA	30 let		CM_D_30.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	VEGA	0,5 leta		CM_V_00.50	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	VEGA	1 leto		CM_V_01.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	VEGA	3 leta		CM_V_03.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	VEGA	5 let		CM_V_05.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	VEGA	10 let		CM_V_10.00	Člen 325p Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	CURVATURE		Sprememba navzgor	CM_CU	Člena 325p in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
CM	CURVATURE		Sprememba navzdol	CM_CD	Člena 325p in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 leta	Dolžniški instrument	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 leto	Dolžniški instrument	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013

CSR_NON_SEC	DELTA	3 leta	Dolžniški instrument	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 let	Dolžniški instrument	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 let	Dolžniški instrument	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 leta	Kreditna zamenjava	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 leto	Kreditna zamenjava	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 leta	Kreditna zamenjava	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 let	Kreditna zamenjava	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 let	Kreditna zamenjava	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 leta		CSR_NON_SEC_V_00.50	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	1 leto		CSR_NON_SEC_V_01.00	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	3 leta		CSR_NON_SEC_V_03.00	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	5 let		CSR_NON_SEC_V_05.00	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	10 let		CSR_NON_SEC_V_10.00	Člen 325m Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Sprememba navzgor	CSR_NON_SEC_CU	Člena 325m in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Sprememba navzdol	CSR_NON_SEC_CD	Člena 325m in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 leta	Dolžniški instrument	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 leto	Dolžniški instrument	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 leta	Dolžniški instrument	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 let	Dolžniški instrument	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 let	Dolžniški instrument	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 leta	Kreditna zamenjava	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 leto	Kreditna zamenjava	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013

CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 leta	Kreditna zamenjava	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 let	Kreditna zamenjava	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 let	Kreditna zamenjava	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 leta		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 leto		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 leta		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 let		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 let		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Sprememba navzgor	CSR_SEC_ACTP_CU	Člena 325n in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Sprememba navzdol	CSR_SEC_ACTP_CD	Člena 325n in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 leta	Dolžniški instrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_DEBT	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 leto	Dolžniški instrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_DEBT	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 leta	Dolžniški instrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_DEBT	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 let	Dolžniški instrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_DEBT	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 let	Dolžniški instrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_DEBT	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 leta	Kreditna zamenjava	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 leto	Kreditna zamenjava	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013

CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 leta	Kreditna zamenjava	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 let	Kreditna zamenjava	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 let	Kreditna zamenjava	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	0,5 leta		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	1 leto		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	3 leta		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	5 let		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	10 let		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Člen 325n Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVATURE		Sprememba navzgor	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Člena 325n in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVATURE		Sprememba navzdol	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Člena 325n in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
EQ	DELTA		Promptna cena	EQ_D_SPOT	Člen 325o Uredbe (EU) št. 575/2013
EQ	DELTA		Cena repo posla	EQ_D_REPO	Člen 325o Uredbe (EU) št. 575/2013
EQ	VEGA	0,5 leta		EQ_V_00.50	Člen 325o Uredbe (EU) št. 575/2013
EQ	VEGA	1 leto		EQ_V_01.00	Člen 325o Uredbe (EU) št. 575/2013
EQ	VEGA	3 leta		EQ_V_03.00	Člen 325o Uredbe (EU) št. 575/2013
EQ	VEGA	5 let		EQ_V_05.00	Člen 325o Uredbe (EU) št. 575/2013
EQ	VEGA	10 let		EQ_V_10.00	Člen 325o Uredbe (EU) št. 575/2013
EQ	CURVATURE		Sprememba navzgor	EQ_CU	Člena 325o in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013

EQ	CURVATURE		Sprememba navzdol	EQ_CD	Člena 325o in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
FX	DELTA			FX_D	Člen 325q Uredbe (EU) št. 575/2013
FX	VEGA	0,5 leta		FX_V_00.50	Člen 325q Uredbe (EU) št. 575/2013
FX	VEGA	1 leto		FX_V_01.00	Člen 325q Uredbe (EU) št. 575/2013
FX	VEGA	3 leta		FX_V_03.00	Člen 325q Uredbe (EU) št. 575/2013
FX	VEGA	5 let		FX_V_05.00	Člen 325q Uredbe (EU) št. 575/2013
FX	VEGA	10 let		FX_V_10.00	Člen 325q Uredbe (EU) št. 575/2013
FX	CURVATURE		Sprememba navzgor	FX_CU	Člena 325q in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
FX	CURVATURE		Sprememba navzdol	FX_CD	Člena 325q in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA	0,25 leta		GIRR_D_00.25	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA	0,5 leta		GIRR_D_00.50	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA	1 leto		GIRR_D_01.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA	2 leti		GIRR_D_02.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA	3 leta		GIRR_D_03.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA	5 let		GIRR_D_05.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA	10 let		GIRR_D_10.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA	15 let		GIRR_D_15.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA	20 let		GIRR_D_20.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA	30 let		GIRR_D_30.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA		Inflacija	GIRR_D_INF	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013

GIRR	DELTA		Medvalutna osnova (prek EUR)	GIRR_D_CRO_EUR	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	DELTA		Medvalutna osnova (prek USD)	GIRR_D_CRO_USD	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 leta – 0,5 leta		GIRR_V_00.50_00.50	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	1 leto < 0,5 leta		GIRR_V_01.00_00.50	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	3 leta – 0,5 leta		GIRR_V_03.00_00.50	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	5 let – 0,5 leta		GIRR_V_05.00_00.50	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	10 let – 0,5 leta		GIRR_V_10.00_00.50	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 leta – 1 leto		GIRR_V_00.50_01.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	1 leto – 1 leto		GIRR_V_01.00_01.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	3 leta – 1 leto		GIRR_V_03.00_01.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	5 let – 1 leto		GIRR_V_05.00_01.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	10 let – 1 leto		GIRR_V_10.00_01.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 leta – 3 leta		GIRR_V_00.50_03.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	1 leto < 3 leta		GIRR_V_01.00_03.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	3 leta – 3 leta		GIRR_V_03.00_03.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	5 let – 3 leta		GIRR_V_05.00_03.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	10 let – 3 leta		GIRR_V_10.00_03.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013

GIRR	VEGA	0,5 leta – 5 let		GIRR_V_00.50_05.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	1 leto < 5 let		GIRR_V_01.00_05.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	3 let – 5 leta		GIRR_V_03.00_05.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	5 let – 5 let		GIRR_V_05.00_05.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	10 let – 5 let		GIRR_V_10.00_05.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 leta – 10 let		GIRR_V_00.50_10.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	1 leto < 10 let		GIRR_V_01.00_10.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	3 leta – 10 let		GIRR_V_03.00_10.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	5 let – 10 let		GIRR_V_05.00_10.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	10 let – 10 let		GIRR_V_10.00_10.00	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 leta	Inflacija	GIRR_V_00.50_INF	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	1 leto	Inflacija	GIRR_V_01.00_INF	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	3 leta	Inflacija	GIRR_V_03.00_INF	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	5 let	Inflacija	GIRR_V_05.00_INF	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	10 let	Inflacija	GIRR_V_10.00_INF	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 leta	Medvalutna osnova (prek EUR)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	1 leto	Medvalutna osnova (prek EUR)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	3 leta	Medvalutna osnova (prek EUR)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013

GIRR	VEGA	5 let	Medvalutna osnova (prek EUR)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	10 let	Medvalutna osnova (prek EUR)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 leta	Medvalutna osnova (prek USD)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	1 leto	Medvalutna osnova (prek USD)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	3 leta	Medvalutna osnova (prek USD)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	5 let	Medvalutna osnova (prek USD)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	VEGA	10 let	Medvalutna osnova (prek USD)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Člen 325l Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Sprememba navzgor	GIRR_CU	Člena 325l in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Sprememba navzdol	GIRR_CD	Člena 325l in 325g Uredbe (EU) št. 575/2013“

PRILOGA IV

„PRILOGA VII

Rezultati portfeljev za nadzorniško primerjanje. TRŽNO TVEGANJE

REZULTATI PORTFELJEV ZA PRIMERJANJE TRŽNO TVEGANJE			
Številka predloge	Koda predloge	Ime predloge / skupine predlog	Kratko ime
		ZAČETNA TRŽNA VREDNOST	
106	C 106.00	ZAČETNO TRŽNO VREDNOTENJE IN UTEMELJITEV IZKLJUČITVE	IMV
106,01	C 106.01	OBČUTLJIVOSTI NA TVEGANJA PO INSTRUMENTIH	SENSITIVITIES
106,02	C 106.02	SBM. SESTAVA KAPITALSKIH ZAHTEV (OFR) PO PORTFELJIH ZA VALIDACIJO SBM	SBM Validation
		VaR, sVaR in PV	
107,1	C 107.01	PODATKI	VaR&SVaR 1
107,2	C 107.02	REZULTATI V VALUTI PORTFELJA EBA	VaR&SVaR 2
		ČASOVNA VRSTA PODATKOV O POSLOVNEM IZIDU	
108	C 108.00	ČASOVNA VRSTA PODATKOV O POSLOVNEM IZIDU	P&L
		PRESEŽNO TVEGANJE NEPLAČILA IN MIGRACIJE (IRC)	
109,1	C 109.01	PRESEŽNO TVEGANJE NEPLAČILA IN MIGRACIJE. PODATKI O MODELU	IRC 1
109,2	C 109.02	PRESEŽNO TVEGANJE NEPLAČILA IN MIGRACIJE. PODATKI PO PORTFELJIH	IRC 2
109,3	C 109.03	PRESEŽNO TVEGANJE NEPLAČILA IN MIGRACIJE. ZNESEK PO PORTFELJU/DATUMU	IRC 3
		TRGOVANJE S KORELACIJO	
110,1	C 110.01	TRGOVANJE S KORELACIJO. PODATKI O MODELU	CT 1
110,2	C 110.02	TRGOVANJE S KORELACIJO. PODATKI PO PORTFELJIH	CT 2
110,3	C 110.03	TRGOVANJE S KORELACIJO. ZNESEK PO PORTFELJU/DATUMU	CT 3
		ASA (SBM in DRC)	
120,01	C 120.01	SBM. OBČUTLJIVOSTI NA TVEGANJA PO INSTRUMENTU/PORTFELJU	SBM 1
120,02	C 120.02	SBM. SESTAVA KAPITALSKIH ZAHTEV PO PORTFELJIH	SBM 2
120,04	C 120.04	DRC. TRŽNE VREDNOSTI IN BRUTO ZNESKI SKOKOVITEGA NARAŠČANJA VERJETNOSTI NEPLAČILA (JTD) PO INSTRUMENTIH/PORTFELJIH	DRC 1
120,05	C 120.05	DRC. SESTAVA KAPITALSKIH ZAHTEV PO PORTFELJIH	DRC 2
120,06	C 120.06	ASA. KAPITALSKE ZAHTEVE PO PORTFELJIH	ASA OFR

C 106.00 – ZAČETNO TRŽNO VREDNOTENJE IN UTEMELJITEV IZKLJUČITVE

Številka instrumenta	Modeliranost instrumenta za VaR + sVaR (DA/NE)	Modeliranost instrumenta za IRC (DA/NE)	Modeliranost instrumenta za trgovanje s korelacijo (DA/NE)	Utemeljitev izključitve	Polje za prosto besedilo	Začetna tržna vrednost
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 106.01 – OBČUTLJIVOSTI NA TVEGANJA PO INSTRUMENTIH

Številka instrumenta

Identifikator dejavnika tveganja	Skupina	Dodatni identifikator	Občutljivost na tveganje (rezultati v valuti poročanja)	Valuta poročanja	Občutljivost na tveganje (rezultati v valuti instrumenta EBA)	Model določanja cen	Opredelevitev občutljivosti	Polje za prosto besedilo	Dodatni identifikator 2	Kategorija kreditne kakovosti
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

C 106.02 – SBM. SESTAVA KAPITALSKIH ZAHTEV (OFR) PO PORTFELJIH ZA VALIDACIJO SBM

Portfelj

Razred tveganja	Sestavina tveganja	Scenarij korelacij	Kapitalske zahteve (rezultati v valuti poročanja)	Predložitev rezultatov portfeljev za validacijo SBM	Polje za prosto besedilo
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 107.01 – VaR, sVaR in PV. PODATKI

		Možnost	Polje za prosto besedilo
		0010	0020
Tvegana vrednost (VaR)			
0010	Metodologija		
0020	Izračun 10-dnevnega obdobja		
0030	Dolžina obdobja spremljanja		
0040	Tehtanje podatkov		
0050	Prištevek za testiranje za nazaj		
0060	Regulativni prištevek za tvegano vrednost (VaR)		
Stresna tvegana vrednost (sVaR)			
0070	Metodologija		
0080	Izračun 10-dnevnega obdobja		
0090	Regulativni prištevek za stresno tvegano vrednost (sVaR)		
0100	Obdobje za stresno tvegano vrednost (sVaR)		

C 107.02 – VaR in sVaR za trgovalne portfelje brez korelacije. REZULTATI V VALUTI PORTFELJA EBA

Portfelj

Datum	Tvegana vrednost (VaR)	Stresna tvegana vrednost (sVaR)	Sedanja vrednost (PV)
0010	0020	0030	0040

C 108.00 – ČASOVNA VRSTA PODATKOV O POSLOVNEM IZIDU

Portfelj

Datum	Dnevni poslovni izid
0010	0020

C 109.01 – IRC. PODATKI O MODELU

		Možnost	Polje za prosto besedilo
Vrstica	Postavka	0010	0020
0010	Število dejavnikov za modeliranje		
0020	Vir izgub ob neplačilu (LGD)		

C 109.02 – IRC. PODATKI PO PORTFELJIH

Portfelj

		Možnost	Polje za prosto besedilo
Vrstica	Postavka	0010	0020
0010	Obdobje likvidnosti		
0020	Vir verjetnosti neplačila		
0030	Vir matrik prehoda		

C 109.03 – IRC. ZNESEK PO PORTFELJU/DATUMU

Portfelj

Datum	Presežno tveganje neplačila in migracije (IRC)
0010	0020

C 110.01 – TRGOVANJE S KORELACIJO. PODATKI O MODELU

		Možnost	Polje za prosto besedilo
Vrstica	Postavka	0010	0020
0010	Število dejavnikov za modeliranje		
0020	Vir izgub ob neplačilu (LGD)		

C 110.02 – TRGOVANJE S KORELACIJO. PODATKI PO PORTFELJIH

Portfelj

		Možnost	Polje za prosto besedilo
Vrstica	Postavka	0010	0020
0010	Obdobje likvidnosti		
0020	Vir verjetnosti neplačila		
0030	Vir matrik prehoda		

C 110.03 –TRGOVANJE S KORELACIJO. VSA CENOVNA TVEGANJA (APR) PO PORTFELJIH/DATUMU

Portfelj

Datum	Vsa cenovna tveganja (APR)
0010	0060

C 120.01 – SBM. OBČUTLJIVOSTI NA TVEGANJA PO INSTRUMENTU/PORTFELJU

Portfelj

Številka instrumenta	Identifikator dejavnika tveganja	Skupina	Dodatni identifikator	Občutljivost na tveganje (rezultati v valuti poročanja)	Valuta poročanja	Občutljivost na tveganje (rezultati v valuti portfelja EBA)	Utež tveganja	Dodatni identifikator 2	Kategorija kreditne kakovosti
0010	0020	0030	0040	0060	0070	0080	0090	110	120

C 120.02 – SBM. SESTAVA KAPITALSKIH ZAHTEV PO PORTFELJIH

Portfelj

Razred tveganja	Sestavina tveganja	Scenarij korelacij	Kapitalske zahteve (rezultati v valuti poročanja)	Valuta poročanja	Kapitalske zahteve (rezultati v valuti portfelja EBA)	Pozicije brez izbirnosti, za katere se uporabljajo kapitalske zahteve za tveganje ukrivljenosti	Pristop osnovne valute, ki se uporablja za delta valutno tveganje in valutno tveganje ukrivljenosti	Deljenje sestavin tveganja ukrivljenosti za valutno tveganje s skalarjem	Polje za prosto besedilo
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100

C 120.04 – DRC. Tržne vrednosti in bruto zneski skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila po instrumentih/portfeljih

Portfelj

Celo število

Številka instrumenta	Razred tveganja	Bucket1	Bucket2	Dolžnik	Kategorija kreditne kakovosti	Utež tveganja neplačila	Prednost	Zapadlost	Stopnja poplačljivosti	Usmerjenost	Točka vključitve (%)	Točka izločitve (%)	Rezultati v valuti poročanja				Rezultati v valuti portfelja EBA		
													Hipotečni znesek	Poslovni izid + prilagoditev (P&L + Adjustment)	Bruto znesek skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila	Valuta	Hipotečni znesek	Poslovni izid + prilagoditev (P&L + Adjustment)	Bruto znesek skokovitega naraščanja verjetnosti neplačila
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

C 120.05 – DRC. SESTAVA KAPITALSKIH ZAHTEV PO PORTFELJIH

Portfelj

Celo število

Razred tveganja	Bucket1	Bucket2	Kapitalske zahteve (rezultati v valuti poročanja)	Valuta poročanja	Kapitalske zahteve (rezultati v valuti portfelja EBA)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 120.06 – ASA. KAPITALSKE ZAHTEVE

Številka portfelja	Rezultati v valuti poročanja			Rezultati v valuti portfelja EBA		
	Kapitalske zahteve za metodo na podlagi občutljivosti	Kapitalske zahteve za tveganje neplačila	Kapitalske zahteve za pribitek za preostala tveganja	Kapitalske zahteve za metodo na podlagi občutljivosti	Kapitalske zahteve za tveganje neplačila	Kapitalske zahteve za pribitek za preostala tveganja
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070“.

PRILOGA V

„PRILOGA X

Portfelji za validacijo SBM

Ime lista	Opis
Instrumenti	Instrumenti (občutljivosti in pozicije tveganja ukrivljenosti) za namene validacije SBM
Portfelji	Portfelji za validacijo SBM, opredeljeni kot kombinacije instrumentov, opredeljenih v tej prilogi

Instrument	Identifikator dejavnika tveganja	Skupina	Dodatni identifikator	Dodatni identifikator 2	Kategorija kreditne kakovosti	Občutljivost na tveganje
S_IRV_b25#	GIRR_V_10.00_10.00	USD				400,00
S_IRV_b24#	GIRR_V_10.00_05.00	USD				200,00
S_IRV_b23#	GIRR_V_10.00_03.00	USD				– 900
S_IRV_b22#	GIRR_V_10.00_01.00	USD				950,00
S_IRV_b21#	GIRR_V_10.00_00.50	USD				– 350
S_IRV_b20#	GIRR_V_05.00_10.00	USD				1 000,00
S_IRV_b19#	GIRR_V_05.00_05.00	USD				– 300
S_IRV_b18#	GIRR_V_05.00_03.00	USD				50,00
S_IRV_b17#	GIRR_V_05.00_01.00	USD				300,00
S_IRV_b16#	GIRR_V_05.00_00.50	USD				– 50
S_IRV_e3#	GIRR_V_03.00_CRO_USD	BRL				500,00
S_IRV_b15#	GIRR_V_03.00_10.00	USD				– 400
S_IRV_b14#	GIRR_V_03.00_05.00	USD				700,00
S_IRV_b13#	GIRR_V_03.00_03.00	USD				– 800
S_IRV_b12#	GIRR_V_03.00_01.00	USD				700,00
S_IRV_b11#	GIRR_V_03.00_00.50	USD				– 100
S_IRV_e2#	GIRR_V_01.00_INF	BRL				750,00
S_IRV_b10#	GIRR_V_01.00_10.00	USD				500,00
S_IRV_b9#	GIRR_V_01.00_05.00	USD				50,00

S_IRV_b8#	GIRR_V_01.00_03.00	USD				– 500
S_IRV_b7#	GIRR_V_01.00_01.00	USD				200,00
S_IRV_b6#	GIRR_V_01.00_00.50	USD				900,00
S_IRV_b5#	GIRR_V_00.50_10.00	USD				100,00
S_IRV_c5#	GIRR_V_00.50_10.00	CLP				– 100
S_IRV_d5#	GIRR_V_00.50_10.00	EUR				– 2 000
S_IRV_b4#	GIRR_V_00.50_05.00	USD				100,00
S_IRV_c4#	GIRR_V_00.50_05.00	CLP				100,00
S_IRV_d4#	GIRR_V_00.50_05.00	EUR				1 500,00
S_IRV_b3#	GIRR_V_00.50_03.00	USD				– 500
S_IRV_c3#	GIRR_V_00.50_03.00	CLP				– 300
S_IRV_d3#	GIRR_V_00.50_03.00	EUR				1 000,00
S_IRV_b2#	GIRR_V_00.50_01.00	USD				400,00
S_IRV_c2#	GIRR_V_00.50_01.00	CLP				150,00
S_IRV_d2#	GIRR_V_00.50_01.00	EUR				3 750,00
S_IRV_a1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				– 100
S_IRV_b1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				700,00
S_IRV_c1#	GIRR_V_00.50_00.50	CLP				300,00
S_IRV_d1#	GIRR_V_00.50_00.50	EUR				– 4 750
S_IRV_e1#	GIRR_V_00.50_00.50	BRL				– 500
S_IRD_b11#	GIRR_D_INF	USD				– 50 000
S_IRD_d11#	GIRR_D_INF	CLP				95 000,00
S_IRD_e11#	GIRR_D_INF	EUR	DE			– 65 000
S_IRD_e13#	GIRR_D_INF	EUR	FR			– 100 000
S_IRD_d12#	GIRR_D_CRO_USD	CLP				10 500,00
S_IRD_e12#	GIRR_D_CRO_USD	EUR				– 85 000
S_IRD_b12#	GIRR_D_CRO_EUR	USD				– 65 000
S_IRD_b10#	GIRR_D_30.00	USD	OIS			– 50 000
S_IRD_c10#	GIRR_D_30.00	USD	Libor3m			10 000,00

S_IRD_d10#	GIRR_D_30.00	CLP	OIS			15 000,00
S_IRD_e10#	GIRR_D_30.00	EUR	OIS			– 120 000
S_IRD_b9#	GIRR_D_20.00	USD	OIS			200 000,00
S_IRD_c9#	GIRR_D_20.00	USD	Libor3m			– 30 000
S_IRD_d9#	GIRR_D_20.00	CLP	OIS			90 000,00
S_IRD_e9#	GIRR_D_20.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b8#	GIRR_D_15.00	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_c8#	GIRR_D_15.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d8#	GIRR_D_15.00	CLP	OIS			70 000,00
S_IRD_e8#	GIRR_D_15.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b7#	GIRR_D_10.00	USD	OIS			2 000,00
S_IRD_c7#	GIRR_D_10.00	USD	Libor3m			– 100 000
S_IRD_d7#	GIRR_D_10.00	CLP	OIS			– 25 000
S_IRD_e7#	GIRR_D_10.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b6#	GIRR_D_05.00	USD	OIS			– 90 000
S_IRD_c6#	GIRR_D_05.00	USD	Libor3m			– 35 000
S_IRD_d6#	GIRR_D_05.00	CLP	OIS			– 5 000
S_IRD_e6#	GIRR_D_05.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b5#	GIRR_D_03.00	USD	OIS			85 000,00
S_IRD_c5#	GIRR_D_03.00	USD	Libor3m			55 000,00
S_IRD_d5#	GIRR_D_03.00	CLP	OIS			– 100 000
S_IRD_e5#	GIRR_D_03.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b4#	GIRR_D_02.00	USD	OIS			– 10 000
S_IRD_c4#	GIRR_D_02.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d4#	GIRR_D_02.00	CLP	OIS			5 000,00
S_IRD_e4#	GIRR_D_02.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b3#	GIRR_D_01.00	USD	OIS			– 65 000
S_IRD_c3#	GIRR_D_01.00	USD	Libor3m			70 000,00
S_IRD_d3#	GIRR_D_01.00	CLP	OIS			10 000,00

S_IRD_e3#	GIRR_D_01.00	EUR	OIS				– 50 000
S_IRD_b2#	GIRR_D_00.50	USD	OIS				15 000,00
S_IRD_c2#	GIRR_D_00.50	USD	Libor3m				– 40 000
S_IRD_d2#	GIRR_D_00.50	CLP	OIS				45 000,00
S_IRD_e2#	GIRR_D_00.50	EUR	OIS				100,00
S_IRD_a1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS				30 000,00
S_IRD_b1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS				20 000,00
S_IRD_c1#	GIRR_D_00.25	USD	Libor3m				– 30 000
S_IRD_d1#	GIRR_D_00.25	CLP	OIS				– 30 000
S_IRD_e1#	GIRR_D_00.25	EUR	OIS				100,00
S_IRD_f1#	GIRR_D_00.25	DKK	OIS				100,00
S_IRC_a1#	GIRR_CU	USD					– 18 466,83
S_IRC_b1#	GIRR_CU	USD					92 233,09
S_IRC_c1#	GIRR_CU	CLP					– 1 270
S_IRC_d1#	GIRR_CU	EUR					– 253,12
S_IRC_e1#	GIRR_CU	VND					– 11 950
S_IRC_a1#	GIRR_CD	USD					18 647,66
S_IRC_b1#	GIRR_CD	USD					– 93 178,71
S_IRC_c1#	GIRR_CD	CLP					450,00
S_IRC_d1#	GIRR_CD	EUR					– 3 237,08
S_IRC_e1#	GIRR_CD	VND					– 4 030
S_FXV_b4#	FX_V_5.00	EUR_CLP					200,00
S_FXV_d4#	FX_V_5.00	CHF_VND					1 500,00
S_FXV_b3#	FX_V_3.00	EUR_CLP					– 400
S_FXV_d3#	FX_V_3.00	CHF_VND					1 000,00
S_FXV_b5#	FX_V_10.00	EUR_CLP					150,00
S_FXV_d5#	FX_V_10.00	CHF_VND					– 2 000

S_FXV_b2#	FX_V_1.00	EUR_CLP				300,00
S_FXV_d2#	FX_V_1.00	CHF_VND				3 750,00
S_FXV_a1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				– 100
S_FXV_b1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				700,00
S_FXV_c1#	FX_V_0.50	AUD_JPY				450,00
S_FXV_d1#	FX_V_0.50	CHF_VND				– 4 800
S_FXD_a1#	FX_D	GBP				5 000,00
S_FXD_b1#	FX_D	GBP				– 8 000
S_FXD_c1#	FX_D	CLP				3 000,00
S_FXD_d1#	FX_D	DKK				1 000,00
S_FXD_f1#	FX_D	BGN				1 000,00
S_FXC_a1#	FX_CU	EUR				– 16 037,91
S_FXC_b1#	FX_CU	EUR				80 159,24
S_FXC_c1#	FX_CU	CLP				– 800
S_FXC_d1#	FX_CU	JPY				– 1 472,88
S_FXC_e1#	FX_CU	VND				– 3 400
S_FXC_f1#	FX_CU	DKK				– 48,61
S_FXC_a1#	FX_CD	EUR				16 162,18
S_FXC_b1#	FX_CD	EUR				– 80 723,02
S_FXC_c1#	FX_CD	CLP				700,00
S_FXC_d1#	FX_CD	JPY				– 1 324,35
S_FXC_e1#	FX_CD	VND				– 2 100
S_FXC_f1#	FX_CD	DKK				48,61
S_EQV_a5#	EQ_V_5.00	1	IZDAJATELJ A			100,00
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	IZDAJATELJ AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	IZDAJATELJ AC			– 50
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	IZDAJATELJ AE			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	IZDAJATELJ AF			375,00

S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	IZDAJATELJ B		50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	IZDAJATELJ F		450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	IZDAJATELJ J		– 200
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	IZDAJATELJ K		– 825
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	IZDAJATELJ M		– 700
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	INDEKS N		850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	INDEKS O		150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	IZDAJATELJ Y		700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	IZDAJATELJ A		– 500
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	IZDAJATELJ AA		– 850
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	IZDAJATELJ AD		300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	IZDAJATELJ AE		– 450
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	IZDAJATELJ AF		– 725
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	IZDAJATELJ B		– 500
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	IZDAJATELJ F		250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	IZDAJATELJ J		– 900
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	IZDAJATELJ K		– 975
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	INDEKS N		– 1 250
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	INDEKS O		100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	IZDAJATELJ X		– 200
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	IZDAJATELJ Z		– 800
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	IZDAJATELJ A		100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	IZDAJATELJ AA		– 300
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	IZDAJATELJ AB		– 400
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	IZDAJATELJ AE		– 850
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	IZDAJATELJ AF		525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	IZDAJATELJ B		500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	IZDAJATELJ F		600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	IZDAJATELJ J		150,00

S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	IZDAJATELJ K			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	INDEKS N			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	INDEKS O			– 200
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	INDEKS Q			– 800
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	IZDAJATELJ A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	IZDAJATELJ AA			– 400
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	IZDAJATELJ AE			– 250
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	IZDAJATELJ AF			– 1 150
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	IZDAJATELJ B			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	IZDAJATELJ F			– 750
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	IZDAJATELJ J			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	IZDAJATELJ K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	INDEKS N			– 800
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	INDEKS O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	IZDAJATELJ A			– 100
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	IZDAJATELJ A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	IZDAJATELJ AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	IZDAJATELJ AE			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	IZDAJATELJ AF			– 300
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	IZDAJATELJ B			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	IZDAJATELJ C			– 500
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	IZDAJATELJ D			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	IZDAJATELJ E			– 800
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	IZDAJATELJ F			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	IZDAJATELJ G			– 400
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	IZDAJATELJ H			– 50
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	IZDAJATELJ I			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	IZDAJATELJ J			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	IZDAJATELJ K			– 300

S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	IZDAJATELJ L		1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	INDEKS N		750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	INDEKS O		– 500
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	INDEKS P		40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	IZDAJATELJ A		16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	IZDAJATELJ A		– 35 000
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	IZDAJATELJ B		20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	IZDAJATELJ C		66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	IZDAJATELJ D		1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	IZDAJATELJ E		1 100,00
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	IZDAJATELJ F		25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	IZDAJATELJ G		8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	IZDAJATELJ H		22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	IZDAJATELJ I		– 12 300
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	IZDAJATELJ J		– 450
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	IZDAJATELJ K		– 143
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	IZDAJATELJ L		– 143
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	IZDAJATELJ M		– 100
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	IZDAJATELJ N		– 100
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	IZDAJATELJ O		– 19 600
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	INDEKS Q		1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	INDEKS R		– 40 000
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	INDEKS S		– 1 950
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	INDEKS S		280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	INDEKS T		3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	IZDAJATELJ U		– 57
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	IZDAJATELJ V		– 100
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	IZDAJATELJ A		50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	IZDAJATELJ AA		79 000,00

S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	IZDAJATELJ AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	IZDAJATELJ AC			– 10 000
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	IZDAJATELJ B			– 39 000
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	IZDAJATELJ F			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	IZDAJATELJ G			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	IZDAJATELJ K			– 14 250
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	IZDAJATELJ L			– 150 000
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	IZDAJATELJ M			– 85 000
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	IZDAJATELJ N			– 72 000
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	IZDAJATELJ P			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	INDEKS Q			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	INDEKS R			– 40 000
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	INDEKS T			– 125 000
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	IZDAJATELJ X			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	IZDAJATELJ Y			4 800,00
S_EQD_z1#	EQ_D_REPO	4	IZDAJATELJ Z			– 15 000
S_EQC_a1#	EQ_CU	1	IZDAJATELJ A			– 37 820
S_EQC_a2#	EQ_CU	1	IZDAJATELJ A			77 655,00
S_EQC_aa1#	EQ_CU	2	IZDAJATELJ AA			39 300,00
S_EQC_ab1#	EQ_CU	4	IZDAJATELJ AB			17 262,00
S_EQC_ac1#	EQ_CU	5	IZDAJATELJ AC			7 139,60
S_EQC_ad1#	EQ_CU	6	IZDAJATELJ AD			– 3 642,5
S_EQC_ae1#	EQ_CU	7	IZDAJATELJ AE			3 900,00
S_EQC_af1#	EQ_CU	8	IZDAJATELJ AF			41 550,00
S_EQC_ag1#	EQ_CU	9	IZDAJATELJ AG			36 860,00
S_EQC_ah1#	EQ_CU	10	IZDAJATELJ AH			22 150,00
S_EQC_b1#	EQ_CU	1	IZDAJATELJ B			20 677,50
S_EQC_c1#	EQ_CU	2	IZDAJATELJ C			– 31 440
S_EQC_d1#	EQ_CU	3	IZDAJATELJ D			6 238,00

S_EQC_e1#	EQ_CU	4	IZDAJATELJ E				– 21 605
S_EQC_f1#	EQ_CU	5	IZDAJATELJ F				– 2 850
S_EQC_g1#	EQ_CU	6	IZDAJATELJ G				– 3 642,5
S_EQC_h1#	EQ_CU	7	IZDAJATELJ H				– 7 800
S_EQC_i1#	EQ_CU	8	IZDAJATELJ I				– 29 550
S_EQC_j1#	EQ_CU	9	IZDAJATELJ J				– 216 320
S_EQC_k1#	EQ_CU	10	IZDAJATELJ K				1 950,00
S_EQC_q1#	EQ_CU	11	IZDAJATELJ Q				– 19 142
S_EQC_r1#	EQ_CU	11	IZDAJATELJ R				28 713,00
S_EQC_s1#	EQ_CU	3	IZDAJATELJ S				– 17 025
S_EQC_t1#	EQ_CU	12	IZDAJATELJ T				7 466,67
S_EQC_u1#	EQ_CU	13	IZDAJATELJ U				11 160,00
S_EQC_v1#	EQ_CU	12	IZDAJATELJ V				– 39 200
S_EQC_w1#	EQ_CU	13	IZDAJATELJ W				– 58 590
S_EQC_y1#	EQ_CU	1	IZDAJATELJ Y				– 23 930
S_EQC_z1#	EQ_CU	1	IZDAJATELJ Z				– 47 860
S_EQC_a1#	EQ_CD	1	IZDAJATELJ A				39 157,50
S_EQC_a2#	EQ_CD	1	IZDAJATELJ A				– 80 349
S_EQC_aa1#	EQ_CD	2	IZDAJATELJ AA				– 30 600
S_EQC_ab1#	EQ_CD	4	IZDAJATELJ AB				– 9 826
S_EQC_ac1#	EQ_CD	5	IZDAJATELJ AC				– 5 414,6
S_EQC_ad1#	EQ_CD	6	IZDAJATELJ AD				2 617,50
S_EQC_ae1#	EQ_CD	7	IZDAJATELJ AE				– 2 720
S_EQC_af1#	EQ_CD	8	IZDAJATELJ AF				– 28 250
S_EQC_ag1#	EQ_CD	9	IZDAJATELJ AG				– 30 935
S_EQC_ah1#	EQ_CD	10	IZDAJATELJ AH				– 15 025
S_EQC_b1#	EQ_CD	1	IZDAJATELJ B				– 238 910
S_EQC_c1#	EQ_CD	2	IZDAJATELJ C				24 480,00
S_EQC_d1#	EQ_CD	3	IZDAJATELJ D				– 6 068

S_EQC_e1#	EQ_CD	4	IZDAJATELJ E		12 310,00
S_EQC_f1#	EQ_CD	5	IZDAJATELJ F		2 160,00
S_EQC_g1#	EQ_CD	6	IZDAJATELJ G		2 617,50
S_EQC_h1#	EQ_CD	7	IZDAJATELJ H		5 440,00
S_EQC_i1#	EQ_CD	8	IZDAJATELJ I		20 050,00
S_EQC_j1#	EQ_CD	9	IZDAJATELJ J		181 560,00
S_EQC_k1#	EQ_CD	10	IZDAJATELJ K		– 2 900
S_EQC_q1#	EQ_CD	11	IZDAJATELJ Q		20 052,00
S_EQC_r1#	EQ_CD	11	IZDAJATELJ R		– 30 078
S_EQC_s1#	EQ_CD	3	IZDAJATELJ S		– 9 435
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	IZDAJATELJ T		– 7 400
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	IZDAJATELJ U		– 11 040
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	IZDAJATELJ V		38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	IZDAJATELJ W		57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	IZDAJATELJ Y		13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	IZDAJATELJ Z		27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	IZDAJATELJ A		100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	IZDAJATELJ B		50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	IZDAJATELJ C		150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	IZDAJATELJ AH		– 750
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	IZDAJATELJ A		– 500
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	IZDAJATELJ AB		325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	IZDAJATELJ B		– 500
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	IZDAJATELJ C		100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	INDEKS V		500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	IZDAJATELJ A		100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	IZDAJATELJ B		500,00
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	IZDAJATELJ C		– 200
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	IZDAJATELJ A		400,00

S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	IZDAJATELJ B		200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	IZDAJATELJ C		400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	IZDAJATELJ A		– 100
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	IZDAJATELJ A		700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	IZDAJATELJ B		900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	IZDAJATELJ C		– 500
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	IZDAJATELJ D		700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	IZDAJATELJ E		– 800
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	IZDAJATELJ F		700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	IZDAJATELJ G		– 400
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	IZDAJATELJ H		– 50
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	IZDAJATELJ I		300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	IZDAJATELJ J		50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	IZDAJATELJ K		– 300
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	IZDAJATELJ L		1 000,00
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	IZDAJATELJ M		– 350
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	IZDAJATELJ N		950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	IZDAJATELJ O		– 900
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	IZDAJATELJ P		200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	IZDAJATELJ Q		400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	IZDAJATELJ R		– 300
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEKS S		850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	INDEKS T		– 650
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEKS U		– 350
S_CND_hb2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_DEBT	9	IZDAJATELJ HB		– 17 000
S_CND_t1#	CSR_NON_SEC_D_3.00_DEBT	3	IZDAJATELJ T		– 6 000
S_CND_y1#	CSR_NON_SEC_D_3.00_DEBT	20	INDEKS Y		9 000,00

S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	IZDAJATELJ AC			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	IZDAJATELJ B			– 17 000
S_CND_w1#	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	10	IZDAJATELJ W		CQS 1	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_SEC_D_1.00_DEBT	1	IZDAJATELJ A			– 10 000
S_CND_s1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_DEBT	3	IZDAJATELJ S			– 6 000
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	INDEKS X			– 18 500
S_CND_a1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	1	IZDAJATELJ A			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	1	IZDAJATELJ A			– 30 000
S_CND_b1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	1	IZDAJATELJ B			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	3	IZDAJATELJ C			– 6 000
S_CND_d1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	4	IZDAJATELJ D			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	5	IZDAJATELJ E			– 4 000
S_CND_f1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	6	IZDAJATELJ F			– 8 000
S_CND_g1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	7	IZDAJATELJ G			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	8	IZDAJATELJ H			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	9	IZDAJATELJ AH			– 23 000
S_CND_i1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	10	IZDAJATELJ I		CQS 2	– 5 000
S_CND_j1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	11	IZDAJATELJ J			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	12	IZDAJATELJ K			7 000,00

S_CND_l1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	13	IZDAJATELJ L			– 9 000
S_CND_m1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	14	IZDAJATELJ M			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	15	IZDAJATELJ N			– 20 000
S_CND_o1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	16	IZDAJATELJ O			5 000,00
S_CND_p1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	17	IZDAJATELJ P			– 3 000
S_CND_q1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	18	IZDAJATELJ Q			10 000,00
S_CND_r1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	18	IZDAJATELJ R			– 5 000
S_CND_a3#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	1	IZDAJATELJ A			15 000,00
S_CND_ab1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	2	IZDAJATELJ AB			21 000,00
S_CND_u1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDEKS U			– 32 000
S_CND_v1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	20	INDEKS V			– 13 000
S_CND_x2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDEKS X			52 500,00
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CU	1	IZDAJATELJ A			– 2 338,64
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CU	1	IZDAJATELJ A			35 116,67
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CU	10	IZDAJATELJ AA		CQS 1	– 1 212,5
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CU	2	IZDAJATELJ AB1			– 247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CU	1	IZDAJATELJ B			890,91
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CU	3	IZDAJATELJ C			– 500
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CU	4	IZDAJATELJ D			415,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CU	5	IZDAJATELJ E			– 1 050
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CU	6	IZDAJATELJ F			– 150
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CU	7	IZDAJATELJ G			– 318,75
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CU	8	IZDAJATELJ H			– 425
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CU	9	IZDAJATELJ HB1			– 500
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CU	10	IZDAJATELJ I		CQS 2	– 937,5

S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CU	11	IZDAJATELJ J			– 4 650
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CU	12	IZDAJATELJ K			– 425
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CU	13	IZDAJATELJ L			– 27 660
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CU	14	IZDAJATELJ M			– 488
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CU	15	IZDAJATELJ N			13 237,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CU	16	IZDAJATELJ O			– 1 127,5
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CU	17	IZDAJATELJ P			– 5 775
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CU	18	IZDAJATELJ Q			– 7 842
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CU	18	IZDAJATELJ R			15 684,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CU	4	IZDAJATELJ S			– 750
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CU	19	IZDAJATELJ T			3 550,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CU	20	IZDAJATELJ U			1 660,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CU	19	IZDAJATELJ V			– 18 637,5
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CU	20	IZDAJATELJ W			– 8 715
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CU	3	IZDAJATELJ X			– 500
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CU	1	IZDAJATELJ Y			– 249,95
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CU	1	IZDAJATELJ Z			– 249,95
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CD	1	IZDAJATELJ A			2 363,38
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CD	1	IZDAJATELJ A			– 35 314,65
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CD	10	IZDAJATELJ AA		CQS 1	1 150,00
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CD	2	IZDAJATELJ AB1			247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CD	1	IZDAJATELJ B			– 5 543,43
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CD	3	IZDAJATELJ C			500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CD	4	IZDAJATELJ D			– 385
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CD	5	IZDAJATELJ E			575,00
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CD	6	IZDAJATELJ F			75,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CD	7	IZDAJATELJ G			287,50
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CD	8	IZDAJATELJ H			400,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CD	9	IZDAJATELJ HB1			500,00

S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CD	10	IZDAJATELJ I		CQS 2	750,00
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CD	11	IZDAJATELJ J			4 100,00
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	IZDAJATELJ K			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	IZDAJATELJ L			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	IZDAJATELJ M			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	IZDAJATELJ N			– 23 437,5
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	IZDAJATELJ O			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	IZDAJATELJ P			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	IZDAJATELJ Q			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	IZDAJATELJ R			– 17 504
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	IZDAJATELJ S			– 250
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	IZDAJATELJ T			– 3 500
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	IZDAJATELJ U			– 1 540
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	IZDAJATELJ V			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	IZDAJATELJ W			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	IZDAJATELJ X			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	IZDAJATELJ Y			– 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	IZDAJATELJ Z			– 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	PREMOG			– 300
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	URAN			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	PREMOG			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	URAN			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	PREMOG			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	URAN			– 250
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	PREMOG			– 200
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	URAN			– 750
S_CMV_d1#	CM_V_1.00	2	WTI			– 175
S_CMV_f1#	CM_V_1.00	3	FWD ELEKTRIKA NE			– 450

S_CMV_h1#	CM_V_1.00	4	PANAMAX			– 5 500
S_CMV_j1#	CM_V_1.00	5	BAKER			– 200
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	UTEKOČINJENI ZEMELJSKI PLIN			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	SREBRO			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	KORUZA			– 1 000
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	SIROTKA			– 125
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	GUMA			– 50
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	KALIJEV OKSID			– 1 800
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	PREMOG			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	PREMOG			– 350
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	URAN			150,00
S_CMV_c1#	CM_V_0.50	2	BRENT			200,00
S_CMV_e1#	CM_V_0.50	3	SPOT ELECTRICITY SE			– 300
S_CMV_g1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000
S_CMV_i1#	CM_V_0.50	5	JEKLO			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	ZEMELJSKI PLIN			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	ZLATO			– 200
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	SOJINA ZRNA			– 750
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	RIBE			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	KAKAV			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	PLOSKO STEKLO			3 000,00
S_CMV_w1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000
S_CMV_x1#	CM_V_0.50	4	PANAMAX			15 000,00
S_CMD_p1#	CM_D_30.00	8	KORUZA	OKLAHOMA		– 10 000
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FWD ELEKTRIKA NE	TEKSAS		– 4 500
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		– 68 750

S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	SREBRO	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	SIROTKA	NEWCASTLE		- 1 250
S_CMD_d1#	CM_D_2.00	2	WTI	OKLAHOMA		- 1 750
S_CMD_l1#	CM_D_15.00	6	UTEKOČINJENI ZEMELJSKI PLIN	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	GUMA	NEWCASTLE		- 500
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	BAKER	OKLAHOMA		- 2 000
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	KALIJEV OKSID	NEWCASTLE		- 18 000
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	URAN	OKLAHOMA		1 500,00
S_CMD_g1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		- 62 500
S_CMD_w1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		- 62 500
S_CMD_x1#	CM_D_1.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		187 500,00
S_CMD_a4#	CM_D_0.50	1	PREMOG	NEWCASTLE		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	PREMOG	NEWCASTLE		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	PREMOG	NEWCASTLE		- 3 500
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	PREMOG	LONDON		- 2 000
S_CMD_c1#	CM_D_0.00	2	BRENT	LE HAVRE		2 000,00
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	SPOT ELECTRICITY SE	LONDON		- 3 000
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	JEKLO	LE HAVRE		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	ZEMELJSKI PLIN	LE HAVRE		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	ZLATO	UK1		- 2 000
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	SOJINA ZRNA	LE HAVRE		- 7 500
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	RIBE	LONDON		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	KAKAV	LONDON		3 500,00

S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	PLOSKO STEKLO	LONDON		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	PREMOG			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	PREMOG			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	URAN			6 635,00
S_CMC_c1#	CM_CU	2	BRENT			- 11 600
S_CMC_d1#	CM_CU	2	WTI			- 36 900
S_CMC_e1#	CM_CU	3	SPOT ELECTRICITY SE			8 563,00
S_CMC_f1#	CM_CU	3	FWD ELEKTRIKA NE			- 27 250
S_CMC_g1#	CM_CU	4	SUPRAMAX			- 36 880
S_CMC_h1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00
S_CMC_i1#	CM_CU	5	JEKLO			- 5 850
S_CMC_j1#	CM_CU	5	BAKER			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	ZEMELJSKI PLIN			- 6 147,5
S_CMC_l1#	CM_CU	6	UTEKOČINJENI ZEMELJSKI PLIN			- 6 147,5
S_CMC_m1#	CM_CU	7	ZLATO			- 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	SREBRO			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	SOJINA ZRNA			- 14 535
S_CMC_p1#	CM_CU	8	KORUZA			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	RIBE			- 19 900
S_CMC_r1#	CM_CU	9	SIROTKA			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	KAKAV			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	GUMA			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	PLOSKO STEKLO			- 13 790
S_CMC_v1#	CM_CU	11	KALIJEV OKSID			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	MLEKO			- 6 300
S_CMC_y1#	CM_CU	1	URAN			- 65 864
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

S_CMC_a1#	CM_CD	1	PREMOG			- 18 260
S_CMC_a2#	CM_CD	1	PREMOG			- 37 630
S_CMC_b1#	CM_CD	1	URAN			- 70 460
S_CMC_c1#	CM_CD	2	BRENT			8 320,00
S_CMC_d1#	CM_CD	2	WTI			3 550,00
S_CMC_e1#	CM_CD	3	SPOT ELECTRICITY SE			- 8 233
S_CMC_f1#	CM_CD	3	FWD ELEKTRIKA NE			16 370,00
S_CMC_g1#	CM_CD	4	SUPRAMAX			29 110,00
S_CMC_h1#	CM_CD	4	PANAMAX			- 15 256
S_CMC_i1#	CM_CD	5	JEKLO			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	BAKER			- 10 219,8
S_CMC_k1#	CM_CD	6	ZEMELJSKI PLIN			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	UTEKOČINJENI ZEMELJSKI PLIN			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	ZLATO			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	SREBRO			- 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	SOJINA ZRNA			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	KORUZA			- 14 735
S_CMC_q1#	CM_CD	9	RIBE			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	SIROTKA			- 3 012
S_CMC_s1#	CM_CD	10	KAKAV			- 1 415
S_CMC_t1#	CM_CD	10	GUMA			- 7 817,2
S_CMC_u1#	CM_CD	11	PLOSKO STEKLO			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	KALIJEV OKSID			- 21 300
S_CMC_x1#	CM_CD	9	MLEKO			- 4 700
S_CMC_y1#	CM_CD	1	URAN			- 66 344
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			- 22 856

Portfelj	Razred tveganja	Sestavina	Instrumenti
G000	GIRR	DELTA	S_IRD_a1#
G001	GIRR	DELTA	S_IRD_b1#
G002	GIRR	DELTA	S_IRD_b2#
G003	GIRR	DELTA	S_IRD_b3#
G004	GIRR	DELTA	S_IRD_b4#
G005	GIRR	DELTA	S_IRD_b5#
G006	GIRR	DELTA	S_IRD_b6#
G007	GIRR	DELTA	S_IRD_b7#
G008	GIRR	DELTA	S_IRD_b8#
G009	GIRR	DELTA	S_IRD_b9#
G010	GIRR	DELTA	S_IRD_b10#
G011	GIRR	DELTA	S_IRD_b11#
G012	GIRR	DELTA	S_IRD_b12#
G013	GIRR	DELTA	S_IRD_d1#
G014	GIRR	DELTA	S_IRD_d2#
G015	GIRR	DELTA	S_IRD_d3#
G016	GIRR	DELTA	S_IRD_d4#
G017	GIRR	DELTA	S_IRD_d5#
G018	GIRR	DELTA	S_IRD_d6#
G019	GIRR	DELTA	S_IRD_d7#
G020	GIRR	DELTA	S_IRD_d8#
G021	GIRR	DELTA	S_IRD_d9#
G022	GIRR	DELTA	S_IRD_d10#
G023	GIRR	DELTA	S_IRD_d11#
G024	GIRR	DELTA	S_IRD_d12#
G025	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1#
G026	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10#
G027	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_c1#
G028	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10#

G029	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11#
G030	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12#
G031	GIRR	DELTA	S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c6#
G032	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12#
G033	GIRR	DELTA	S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13#
G034	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1#
G035	GIRR	VEGA	S_IRV_b1#
G036	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1#
G037	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5#

G038	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b6# S_IRV_b11# S_IRV_b16# S_IRV_b21#
G039	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25#
G040	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e2#
G041	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e3#
G042	GIRR	VEGA	S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G043	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5#
G044	GIRR	VEGA	S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G045	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3#
G046	GIRR	UKRIVLJENOST	S_IRC_b1#
G047	GIRR	UKRIVLJENOST	S_IRC_c1#
G048	GIRR	UKRIVLJENOST	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	GIRR	UKRIVLJENOST	S_IRC_d1#
G050	GIRR	UKRIVLJENOST	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	GIRR	UKRIVLJENOST	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	GIRR	UKRIVLJENOST	S_IRC_d1# S_IRC_e1#

G053	GIRR	UKRIVLJENOST	S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G054	GIRR	VSE	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1# S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G055	GIRR	DELTA	S_IRD_e11# S_IRD_e13#
G056	GIRR	DELTA	S_IRD_e1# S_IRD_f1#
E001	EQ	DELTA	S_EQD_a2#
E002	EQ	DELTA	S_EQD_c1#
E003	EQ	DELTA	S_EQD_d1#
E004	EQ	DELTA	S_EQD_e1#
E005	EQ	DELTA	S_EQD_f1#
E006	EQ	DELTA	S_EQD_h1#
E007	EQ	DELTA	S_EQD_i1#
E008	EQ	DELTA	S_EQD_j1#
E009	EQ	DELTA	S_EQD_k1#
E010	EQ	DELTA	S_EQD_m1#
E011	EQ	DELTA	S_EQD_o1#
E012	EQ	DELTA	S_EQD_q1#
E013	EQ	DELTA	S_EQD_s1#

E014	EQ	DELTA	S_EQD_a3#
E015	EQ	DELTA	S_EQD_x1#
E016	EQ	DELTA	S_EQD_y1#
E017	EQ	DELTA	S_EQD_z1#
E018	EQ	DELTA	S_EQD_f2#
E019	EQ	DELTA	S_EQD_aa1#
E020	EQ	DELTA	S_EQD_ab1#
E021	EQ	DELTA	S_EQD_ac1#
E022	EQ	DELTA	S_EQD_k2#
E023	EQ	DELTA	S_EQD_m2#
E024	EQ	DELTA	S_EQD_p1#
E025	EQ	DELTA	S_EQD_q2#
E026	EQ	DELTA	S_EQD_t1#
E027	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2#
E028	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_a3#
E029	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b1#
E030	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b2#
E031	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_f2#
E032	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g1#
E033	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g2#
E034	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_k2#
E035	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1#
E036	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l2#
E037	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_m2#
E038	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n1#
E039	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n2#
E040	EQ	DELTA	S_EQD_o1# S_EQD_p1#
E041	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_q2#
E042	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_r1#
E043	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1#
E044	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1# S_EQD_t2#
E045	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_c1# S_EQD_d1# S_EQD_e1# S_EQD_f1# S_EQD_h1# S_EQD_i1# S_EQD_j1# S_EQD_k1# S_EQD_m1#
E046	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_o1#
E047	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_s1#
E048	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_q1#

E049	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1# S_EQD_m1# S_EQD_n1# S_EQD_q1# S_EQD_s2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E050	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E051	EQ	VEGA	S_EQV_a2#
E052	EQ	VEGA	S_EQV_c1#
E053	EQ	VEGA	S_EQV_d1#
E054	EQ	VEGA	S_EQV_e1#
E055	EQ	VEGA	S_EQV_f1#
E056	EQ	VEGA	S_EQV_g1#
E057	EQ	VEGA	S_EQV_h1#
E058	EQ	VEGA	S_EQV_i1#
E059	EQ	VEGA	S_EQV_j1#
E060	EQ	VEGA	S_EQV_k1#
E061	EQ	VEGA	S_EQV_l1#
E062	EQ	VEGA	S_EQV_n1#
E063	EQ	VEGA	S_EQV_p1#
E064	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2#
E065	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6#
E066	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_b1#
E067	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5#
E068	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5#
E069	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_aa1#
E070	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5#
E071	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#
E072	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_ae1#

E073	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5#
E074	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5#
E075	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_af1#
E076	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5#
E077	EQ	VEGA	S_EQV_l1# S_EQV_m1#
E078	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5#
E079	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_o1#
E080	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E081	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E082	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_c1# S_EQV_d1# S_EQV_e1# S_EQV_f1# S_EQV_g1# S_EQV_h1# S_EQV_i1# S_EQV_j1# S_EQV_k1#
E083	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_m1#
E084	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_p1#
E085	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_n1#
E086	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1#
E087	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1#

E088	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_b1#
E089	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_c1#
E090	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_d1#
E091	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_e1#
E092	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_f1#
E093	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_g1#
E094	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_h1#
E095	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_i1#
E096	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_j1#
E097	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_k1#
E098	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_q1#
E099	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_t1#
E100	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_u1#
E101	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_t1# S_EQC_v1#
E108	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E109	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_s1#
E110	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_a2# S_EQC_c1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_f1# S_EQC_g1# S_EQC_h1# S_EQC_i1# S_EQC_j1# S_EQC_k1#
E111	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_a2# S_EQC_q1#
E112	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E113	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_a2# S_EQC_t1#
E114	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1#
E115	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1#

E116	EQ	UKRIVLJENOST	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E117	EQ	VSE	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1# S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
F001	FX	DELTA	S_FXD_b1#

F002	FX	DELTA	S_FXD_c1#
F003	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1#
F005	FX	DELTA	S_FXD_b1# S_FXD_c1#
F007	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_f1#
F008	FX	VEGA	S_FXV_b1#
F009	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1#
F010	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5#
F011	FX	VEGA	S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F012	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1#
F013	FX	VEGA	S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F014	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F015	FX	UKRIVLJENOST	S_FXC_b1#
F016	FX	UKRIVLJENOST	S_FXC_c1#
F017	FX	UKRIVLJENOST	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	FX	UKRIVLJENOST	S_FXC_d1#
F019	FX	UKRIVLJENOST	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	FX	UKRIVLJENOST	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	FX	UKRIVLJENOST	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	FX	UKRIVLJENOST	S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_f1#
F023	FX	VSE	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_f1# S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_f1#
F024	FX	DELTA	S_FXD_d1#
F026	FX	DELTA	S_FXD_f1#
F028	FX	UKRIVLJENOST	S_FXC_f1#
N001	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1#
N002	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_c1#
N003	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_d1#

N004	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_e1#
N005	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1#
N006	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_g1#
N007	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_h1#
N008	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_i1#
N009	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_w1#
N010	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1#
N011	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_k1#
N012	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_l1#
N013	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_m1#
N014	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1#
N015	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_o1#
N016	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_p1#
N017	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1#
N018	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1#
N019	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1#
N020	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2#
N021	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a3#
N022	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a4#
N023	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_a4#
N024	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b1#
N025	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1#
N026	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a4# S_CND_b1#
N027	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b2#
N028	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1# S_CND_r1#
N029	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x2#
N030	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1# S_CND_y1#
N031	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x1# S_CND_x2#
N032	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1#
N033	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N034	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N035	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#

N036	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N037	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N038	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N039	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N040	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N041	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N042	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1# S_CND_c1# S_CND_s1# S_CND_t1#
N043	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1#
N044	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2#
N045	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2#
N046	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6#
N047	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_b1#
N048	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5#
N049	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_q1# S_CNV_r1#
N050	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_s1# S_CNV_u1#
N051	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_t1# S_CNV_v1#
N052	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N053	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1#

N054	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N055	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N056	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N057	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N058	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N059	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N060	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N061	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N062	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N063	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_b4# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N064	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1#
N065	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_h1#

N072	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_p1#
N081	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1#
N092	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N093	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N094	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N095	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N096	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N097	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N098	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#

N099	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N100	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#
N103	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1#
N104	CSR_NON_SEC	VSE	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1# S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1#

N104(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_ab1#
N105(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	UKRIVLJENOST	S_CNC_hb1#
N106(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_ab1#
N107(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_hb1#
C001	CM	DELTA	S_CMD_a2#
C002	CM	DELTA	S_CMD_c1#
C003	CM	DELTA	S_CMD_e1#
C004	CM	DELTA	S_CMD_g1#
C005	CM	DELTA	S_CMD_i1#
C006	CM	DELTA	S_CMD_k1#
C007	CM	DELTA	S_CMD_m1#
C008	CM	DELTA	S_CMD_o1#
C009	CM	DELTA	S_CMD_q1#
C010	CM	DELTA	S_CMD_s1#
C011	CM	DELTA	S_CMD_u1#
C012	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2#
C013	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a3#
C014	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a4#
C015	CM	DELTA	S_CMD_a3# S_CMD_a4#
C016	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_b1#
C017	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1#
C018	CM	DELTA	S_CMD_e1# S_CMD_f1#
C019	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1#
C020	CM	DELTA	S_CMD_i1# S_CMD_j1#
C021	CM	DELTA	S_CMD_k1# S_CMD_l1#
C022	CM	DELTA	S_CMD_m1# S_CMD_n1#
C023	CM	DELTA	S_CMD_o1# S_CMD_p1#
C024	CM	DELTA	S_CMD_q1# S_CMD_r1#
C025	CM	DELTA	S_CMD_s1# S_CMD_t1#
C026	CM	DELTA	S_CMD_u1# S_CMD_v1#
C027	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C028	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_c1# S_CMD_e1# S_CMD_g1# S_CMD_i1# S_CMD_k1# S_CMD_m1# S_CMD_o1# S_CMD_q1# S_CMD_s1#
C029	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_u1#
C030	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#

C031	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C032	CM	VEGA	S_CMV_a2#
C033	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2#
C034	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6#
C035	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5#
C036	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1#
C037	CM	VEGA	S_CMV_e1# S_CMV_f1#
C038	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1#
C039	CM	VEGA	S_CMV_i1# S_CMV_j1#
C040	CM	VEGA	S_CMV_k1# S_CMV_l1#
C041	CM	VEGA	S_CMV_m1# S_CMV_n1#
C042	CM	VEGA	S_CMV_o1# S_CMV_p1#
C043	CM	VEGA	S_CMV_q1# S_CMV_r1#
C044	CM	VEGA	S_CMV_s1# S_CMV_t1#
C045	CM	VEGA	S_CMV_u1# S_CMV_v1#
C046	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C047	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_c1# S_CMV_e1# S_CMV_g1# S_CMV_i1# S_CMV_k1# S_CMV_m1# S_CMV_o1# S_CMV_q1# S_CMV_s1#
C048	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_u1#
C049	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C050	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#

C051	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_b1#
C052	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_c1#
C053	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_e1#
C054	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_g1#
C055	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_i1#
C056	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_k1#
C057	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_m1#
C058	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_o1#
C059	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_q1#
C060	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_s1#
C061	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_u1#
C062	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C076	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_e1# S_CMC_g1# S_CMC_i1# S_CMC_k1# S_CMC_m1# S_CMC_o1# S_CMC_q1# S_CMC_s1#
C077	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_a2# S_CMC_u1#
C078	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1#
C079	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C080	CM	UKRIVLJENOST	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_z1#

C081	CM	VSE	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_z1#“.
------	----	-----	---