

FORMULAR DE RAPORTARE
PENTRU EXCLUDEREA UNOR POZIȚII DIN POZIȚIA DESCHISĂ NETĂ

Informații furnizate în conformitate cu pct. 37 din Ghid	
MONEDA POZIȚIEI DESCHISE NETE	
(a) poziția deschisă netă pe monedă anterior aprobării	
(b) poziția deschisă netă rezultată din pozițiile nestructurale exprimate în moneda respectivă	
(c) dimensiunea poziției deschise nete care este structurală și care a fost luată pentru acoperirea indicatorului	
(d) poziția deschisă netă maximă (<i>MaxOP</i>) calculată în conformitate cu punctul 31 din Ghid	
(e) cele două sensibilități de mai jos: <p>(i) $sensitivity_1 = \frac{S_{OP} - MaxOP_{FC}}{RWA_{NoFXFC}}$</p> <p>unde:</p> <p>$S_{OP}$ = dimensiunea poziției deschise nete în valută care este structurală și pe care instituția a luat-o pentru acoperirea indicatorului, excluzând pozițiile corespunzătoare oricăruia dintre următoarele elemente:</p> <ul style="list-style-type: none"> - elementele care au fost deduse din fondurile proprii ale instituției; - elementele nemonetare deținute la costul istoric; - elementele care pot duce la câștiguri sau pierderi care nu au impact asupra fondurilor proprii de nivel 1 de bază în conformitate cu Regulamentul (UE) nr. 575/2013; <p>$MaxOP_{FC}$ = poziția deschisă netă maximă calculată în conformitate cu punctul 31 din Ghid;</p> <p>FC = moneda poziției structurale;</p> <p>RWA_{NoFXFC} = quantumul total al expunerii la risc, calculat în conformitate cu articolul 92 alineatul (3) din Regulamentul (UE), excluzând cerințele de fonduri proprii pentru riscul de schimb valutar pentru toate pozițiile exprimate în valută FC;</p> <p>(ii) sensibilitatea ratei capitalului în funcție de fluctuațiile cursului de schimb, așa cum a fost calculată de instituție</p>	
(f) o evaluare calitativă care să precizeze motivele oricăror modificări ale valorii poziției deschise nete menționate la litera (c) și valorile luate de cele două sensibilități menționate la litera (e)	
(g) cursul de schimb la vedere dintre moneda de raportare și valută FC la data de referință	
(h) orice modificări planificate referitoare la cererea adresată autorității competente	
(i) procentul quantumurilor totale ponderate la riscul de credit în valută în raport cu quantumurile totale ponderate la risc ale instituției	