

Отчет на
(наименование на подфонд/фонд за допълнително пенсионно осигуряване/фонд за извършване на плащания)

.....

(ЕИК)

Стойност на риска по чл. 7, ал. 1 от Наредба № 34

към

№ по ред	Показатели	Текуща експозиция по фючърси, форуърдни валутни договори и договори за лихвен суап	Пазарна стойност на базовия актив на опциите	Делта коефициент на опциите	Процент съгласно таблицата по чл. 7, ал. 5	Добавка, изчислена по чл. 7, ал. 5	Стойност на риска	% от нетните активи на фонда
а	б	1	2	3	4	5	6	7
1.	Пазарен риск (р.1.1.+р.1.2.+р.1.3.+р.1.4.)*	х	х	х	х	х		
1.1.	Пазарен риск на фючърсите (общо):		х	х	х	х		
	в т.ч.	х	х	х	х	х	х	х
			х	х				
			х	х				
1.2.	Пазарен риск на форуърдните валутни договори (общо):		х	х	х	х		
	в т.ч.	х	х	х	х	х	х	х
			х	х				
			х	х				
1.3.	Пазарен риск на договорите за лихвен суап (общо):		х	х	х	х		
	в т.ч.	х	х	х	х	х	х	х
			х	х				
			х	х				
1.4.	Пазарен риск на опциите (общо):	х	х	х	х	х		
	в т.ч.	х			х	х	х	х
		х						
		х						
2.	Риск от неизпълнение на насрещната страна по форуърдни валутни договори, договори за лихвен суап и договорите за извънборсово търгувани опции:**	х	х	х	х	х		
	в т.ч. по контрагенти	х	х	х	х	х	х	х
	риск на контрагент (общо):	х	х	х	х	х		

	в.т.ч. по договори:	x	x	x	x	x	x	x
		x	x	x	x	x		
		x	x	x	x	x		
	в.т.ч. по нетиращо споразумение:	x	x	x	x	x		
	риск на контрагент (общо):	x	x	x	x	x		
	в.т.ч. по договори:	x	x	x	x	x		
		x	x	x	x	x	x	x
		x	x	x	x	x		
	в.т.ч. по нетиращо споразумение:	x	x	x	x	x		
3.	Пазарен риск и риск от неизпълнение на насрещната страна (р.1.+р.2.)	x	x	x	x	x		

Изготвил:
(име,фамилия,подпис)

Представяващи дружеството:
1
(име,фамилия,подпис)
2
(име,фамилия,подпис)

*** За пазарния риск:**

- а) $k.6 = k.1 + k.5$ за фючърсите, форуърдните валутни договори и договорите за лихвен суап;
б) $k.6 = k.2 \times k.3 + k.5$ за опциите.

**** За риска от неизпълнение на насрещната страна по сделката:**

- а) $k.6$ по договора с контрагента = пазарната стойност на договора, когато тя е положителна;
б) $k.6$ за нетиращото споразумение = положителната разлика от нереализираните печалби и загуби по договорите, включени в нетиращото споразумение;
в) $k.6$ за риска на контрагента = $\sum$ от риска по всички договори с този контрагент, включително по нетиращо споразумение.