

IZRAČUN TVEGANJU PRILAGOJENIH POSTAVK ZA IZVEDENE FINANČNE INSTRUMENTE
na dan _____

METODA TEKOČE IZPOSTAVLJENOSTI

v tisoč SIT

Preostala zapadlost	Pogodbena vrednost	Tržna vrednost	% za preračun	Potenc. izpost. za preostali čas	Skupaj nadomestitvena vrednost	Stopnje tveganja v %	Tehtana vrednost
1	2	3	4	5=(2*4)	6=(3+2+5)	7	8=(6*7)
1. IZVEDENI FIN. INST. NA OBRESTNO MERO							
- do 1 leta							
- od 1 do 5 let							
- daljša kot 5 let							
2. IZVEDENI FIN. INST. NA TUJO VALUTO IN ZLATO							
- do 1 leta							
- od 1 do 5 let							
- daljša kot 5 let							
3. IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI NA DELNICE							
- do 1 leta							
- od 1 do 5 let							
- daljša kot 5 let							
4. SKUPAJ							

* Banka, ki izračunava kapitalske zahteve za tržna tveganja, izpolni samo za izvedene finančne instrumente, ki spadajo med bančne postavke.