

(banka)

IZRAČUN KAPITALSKIH ZAHTEV IN KOLIČNIKA KAPITALSKE USTREZNOSTI BANKE

na dan _____

v tisoč SIT

I. TVEGANJU PRILAGOJENA BILANČNA AKTIVA	_____
II. TVEGANJU PRILAGOJENA ZUNAJBILANČNA AKTIVA	_____
III. TVEGANJU PRILAGOJENE POSTAVKE ZA IZVEDENE FINANČNE INSTRUMENTE	_____
IV. SKUPAJ TVEGANJU PRILAGOJENA AKTIVA (zap. I. + II. + III.)	_____
<i>Kapitalska zahteva za kreditno tveganje</i>	
<i>(8% oziroma _____ % od skupaj tveganju prilagojene aktive)</i>	
V. VALUTNIM TVEGANJEM PRILAGOJENE POSTAVKE	_____
<i>(skupna neto pozicija)</i>	
<i>Kapitalska zahteva za valutna tveganja</i>	
<i>(8% oziroma _____ % od skupne neto pozicije)</i>	
VI. TRŽNIM TVEGANJEM PRILAGOJENE POSTAVKE	_____
Skupna kapitalska zahteva za tržna tveganja x 12,5	
1. Kapitalska zahteva za pozicijsko tveganje	
- kap. zahteva za posebno tveganje pri dolžniških finančnih instrumentih	
- kap. zahteva za splošno tveganje pri dolžniških finančnih instrumentih	
- kap. zahteva za tveganje pri lastniških finančnih instrumentih	
2. Kapitalska zahteva za tveganje neizpolnitve nasprotne stranke	
3. Kapitalska zahteva za tveganje spremembe cene blaga	
4. Kapitalska zahteva za tveganje preseganja velikih izpostavljenosti na podlagi trgovanja	
5. Kapitalska zahteva za opcijska tveganja	
<i>Skupna kapitalska zahteva za tržna tveganja (1 + 2 + 3 + 4 + 5)</i>	
VII. Kapitalska zahteva za prekoračena stanja v kapitalu nefinančnih organizacij	_____
VIII. KAPITAL ZA IZRAČUN KOLIČNIKA KAPITALSKE USTREZNOSTI	_____
<i>(Kapital banke - kapitalska zahteva iz VII.)</i>	
IX. KOLIČNIK KAPITALSKE USTREZNOSTI BANKE	_____
<i>(Kapital za izračun / Tveganju prilagojena aktiva + valutnim + tržnim tveganjem prilagojene postavke (z eno decimalko)) x 100%</i>	

Sestavil:

Kontroliral:

Datum:

Žig in podpis odgovorne osebe