

(banka)

**NETO POZICIJE V DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTIH
ZA IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA POSEBNO POZICIJSKO TVEGANJE**
na dan _____

(oznaka valute)

v tisoč SIT

Postavka	Dolga pozicija	Kratka pozicija	Neto pozicija
Postavke brez posebnih tveganj Dolžniški VP Banke Slovenije in Republike Slovenije Dolžniški VP CB in vlad EEA in nekaterih OECD ter ES Drugi netvegani dolžniški VP Netvegani dolžniški VP iz razstavitve izvedenih finančnih instr.			
<i>Vsota absolutnih vrednosti neto pozicij =</i>			_____
Postavke kvalificiranih izdajateljev - preostala zapadlost do 6 mesecev Dolžniški VP Evropske investicijske banke Dolžniški VP multilateralnih razvojnih bank Dolžniški VP domačih bank Dolžniški VP prvovrstnih bank Dolžniški VP drugih bank Drugi ustrezní dolžniški VP *			
<i>Vsota absolutnih vrednosti neto pozicij =</i>			_____
- preostala zapadlost od 6 do 24 mesecev Dolžniški VP Evropske investicijske banke Dolžniški VP multilateralnih razvojnih bank Dolžniški VP domačih bank Dolžniški VP prvovrstnih bank Dolžniški VP drugih bank z zapadlostjo od 6 mesecev do 1 leta Drugi ustrezní dolžniški VP *			
<i>Vsota absolutnih vrednosti neto pozicij =</i>			_____
- preostala zapadlost nad 24 mesecev Dolžniški VP Evropske investicijske banke Dolžniški VP multilateralnih razvojnih bank Dolžniški VP domačih bank Dolžniški VP prvovrstnih bank Drugi ustrezní dolžniški VP *			
<i>Vsota absolutnih vrednosti neto pozicij =</i>			_____
Druge postavke Dolžniški VP drugih bank z zapadlostjo nad 1 letom Dolžniški VP drugih izdajateljev			
<i>Vsota absolutnih vrednosti neto pozicij =</i>			_____

* Drugi dolžniški VP, katerih bonitetna ocena, potrjena s strani vsaj dveh priznanih mednarodnih ocenjevalnih agencij ustreza stopnji kreditnega tveganja 20%.

Tabela se izpolni za vsako valuto posebej!

Banka mora znotraj navedenih kategorij postavk (npr. dolžniški VP BS) ugotavljati neto pozicijo za vsak posamezen dolžniški VP.

Pobot med dolgimi in kratkimi pozicijami je možen le ob izpolnjevanju pogojev iz 20.1. točke sklepa.