

(banka)

Obrazec KAP-trg 5b

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA SPLOŠNO TVEGANJE
PRI DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTIH (pristop, ki temelji na zapadlosti)
na dan _____

II. Izračun tehtanih pozicij, izravnavanje po razredih in skupinah ter izračun kapitalске zahteve

(oznaka valute)

v tisoč SIT

Skupina	Razred	Posamezna neto pozicija (iz Obr. KAP-trg 5a)		Utež (v %)	Tehtana neto pozicija		Po razredih		Po skupinah		Med skupinami	
		Dolga	Kratka		Dolga	Kratka	Izravnano	Neizravnano	Izravnano	Neizravnano	Izravnano	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	x1, y1			0,00%								
1	x2, y2			0,20%					B			
1	x3, y3			0,40%								
1	x4, y4			0,70%							Sk. 1 in 2	
2	x5, y5			1,25%							E	
2	x6, y6			1,75%					C			Sk. 1 in 3
2	x7, y7			2,25%								H
3	x8, y8			2,75%							Sk. 2 in 3	
3	x9, y9			3,25%							F	
3	x10, y10			3,75%								
3	x11, y11			4,50%					D			
3	x12, y12			5,25%								
3	x13, y13			6,00%								
3	y14			8,00%								
3	y15			12,50%								

Skupaj

A

G

Skupna kapitalska zahteva = 10% A + 40% B + 30% (C+D) + 40% (E+F) + 100% G + 150% H = _____

Tabela se izpolni za vsako valuto posebej.