

(banka)

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

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

(oznaka valute)

v tisoč SIT

Skupina	Posamezna neto pozicija (iz Obr. KAP-trg 5c)		Domnevana sprememba obrestne mere (v %)	Modificirano trajanje v letih	Tehtana neto pozicija		Po skupinah		Med skupinami	
	Dolga	Kratka			Dolga	Kratka	Izravnano	Neizravnano	Izravnano	
1	2	3	4	5	6=2x4x5	7=3x4x5	8	9	10	11
1			1,00						Sk. 1 in 2	
2			0,85						B	Sk 1 in 3
3			0,70						Sk. 2 in 3	
									C	

Skupaj

A

E

Skupna kapitalska zahteva = 2% A + 40% (B+C) + 150% D + 100% E = _____

Tabela se izpolni za vsako valuto posebej.