

(banka)

KAPITALSKA ZAHTEVA ZA TVEGANJE NASPROTNE STRANKE
na dan _____

I. Časovna neusklajenost plačila in izročitve

v tisoč SIT

Postavka	Vrednost terjatve	Utež	Tehtana vrednost	Kapitalska zahteva
1	2	3	4=2x3/100	5=0,08x4
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 0%		0%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 20%		20%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 50%		50%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 100%		100%		
Skupaj =				

II. Pogodbe o prodaji in povratnem odkupu, o odkupu in povratni prodaji, o posoji in izposoji VP in blaga

v tisoč SIT

Postavka	Tržna vrednost VP / blaga	Tržna vrednost zavarovanja	Razlika *	Utež	Tehtana vrednost	Kapitalska zahteva
1	2	3	4	5	6=4x5/100	7=0,08x6
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 0%				0%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 20%				20%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 50%				50%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 100%				100%		
Skupaj =						

* Glej točko 28.2.2. sklepa.

III.a. Izvedeni finančni instrumenti, s katerimi se trguje na OTC trgu (metoda tekoče izpostavljenosti)

v tisoč SIT

Preostala zapadlost	Pogodbena vrednost	Tržna vrednost	% za preračun	Potencialna izpostavljenost za preostali čas	Skupaj nadomestitvena vrednost
1	2	3	4	5=(2x4)	6=(3-2+5)
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 fin.inst. na delnice					
- do 1 leta					
- od 1 do 5 let					
- daljša kot 5 let					
Skupaj					

III.b. Izvedeni finančni instrumenti, s katerimi se trguje na OTC trgu (izračun kapitalske zahteve)

v tisoč SIT

Postavka	Nadomestitvena vrednost iz tabele III.a.	Utež	Tehtana vrednost	Kapitalska zahteva
1	2	3	4=2x3/100	5=0,08x4
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 0%		0%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 20%		20%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 50%		50%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 100%		50%		
Skupaj =				

IV. Druga tveganja nasprotne stranke

v tisoč SIT

Postavka	Vrednost terjatve *	Utež	Tehtana vrednost	Kapitalska zahteva
1	2	3	4=2x3/100	5=0,08x4
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 0%		0%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 20%		20%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 50%		50%		
Terjatve do strank, ki ustrezajo stopnji kreditnega tveganja 100%		100%		
Skupaj =				

* Terjatve za plačilo provizij, obresti, dividend, kritij za izvedene finančne instrumente.

v tisoč SIT

Kapitalska zahteva za tveganje neizpolnitve nasprotne stranke	Znesek
Kapitalska zahteva za tveganje poravnave iz Obr. KAP-trg 7a ali KAP-trg 7b	
Kapitalska zahteva za tveganje nasprotne stranke iz poslov z neusklajenim plačilom in izročitvijo	
Kapitalska zahteva za tveganje nasprotne stranke iz naslova pogodb o prodaji in povratnem odkupu ...	
Kapitalska zahteva za tveganje nasprotne stranke iz naslova OTC izvedenih finančnih instrumentov	
Kapitalska zahteva za druga tveganja nasprotne stranke	
Skupaj =	