

(banka)

KAPITALSKA ZAHTEVA ZA OPCIJSKA TVEGANJA
na dan _____

I. ENOSTAVNI PRISTOP

Kupljene opcije

v tisoč SIT

Opcija	Kapitalska zahteva osnovnega instrumenta	Tržna vrednost opcije	Kapitalska zahteva
1	2	3	4 = manjša izmed 2 in 3
Skupaj =			_____

Kombinacija kupljene opcije in varovanega instrumenta

v tisoč SIT

Opcija	Kapitalska zahteva varovanega instrumenta	Znesek "in the-money"	Kapitalska zahteva
1	2	3	4 = 2 - 3
Skupaj =			_____

Kapitalska zahteva enostavni pristop = _____

II. DELTA PLUS PRISTOP

Kapitalska zahteva gama = _____

Kapitalska zahteva vega = _____

Kapitalska zahteva delta plus pristop = Kapitalska zahteva gama + Kapitalska zahteva vega = _____