
(banka)

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

I. Razvrstitev neto pozicij v razrede glede na modificirano trajanje

(oznaka valute)

v tisoč SIT

Skupina	Modificirano trajanje (v letih)	Pozicija		Neto pozicija	
		Dolga	Kratka	Dolga	Kratka
1	2	3	4	5 = 3 - 4	6 = 4 - 3
1	0,0 do 1,0				
2	1,0 do 3,6				
3	več kot 3,6				

Tabela se izpolni za vsako valuto posebej. Banka mora znotraj navedenih skupin 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.