

(banka)

**KAPITALSKA ZAHTEVA ZA POZICIJSKO TVEGANJE
PRI LASTNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTIH**
na dan _____

I. Posebno in splošno tveganje

v tisoč SIT

Postavka	Neto dolga pozicija	Neto kratka pozicija	Bruto pozicija	Neto pozicija
1	2	3	4=2+3	5=2-3
1. Slovenija				
Delnice				
Potrdila o lastništvu				
Delniški indeksi				
Lastniški VP iz razst.izved.fin.instr.				
Skupaj Slovenija			Σ	Σ
2. Država X				
Delnice				
Potrdila o lastništvu				
Delniški indeksi				
Lastniški VP iz razst.izved.fin.instr.				
Skupaj Država X			Σ	Σ
3. Država Y				
...				
SKUPAJ			SBP	SNP

Banka mora znotraj navedenih kategorij postavk (npr. delnice) ugotavljati neto pozicije za vsak posamezen lastniški instrument. Pobot med dolgimi in kratkimi pozicijami je možen le ob izpolnjevanju pogojev iz 20.1. točke sklepa.

Skupna bruto pozicija (SBP) = Bruto pozicija (Slovenija) + Bruto pozicija (Država X) + Bruto pozicija (Država Y) + = _____

Kapitalska zahteva za posebno pozicijsko tveganje = 4% x Skupna bruto pozicija = _____

Skupna neto pozicija (SNP) = Neto pozicija (Slovenija) + Neto pozicija (Država X) + Neto pozicija (Država Y) + = _____

Kapitalska zahteva za splošno pozicijsko tveganje = 8% x Skupna neto pozicija = _____

II. Implicitno obrestno tveganje

v tisoč SIT

Čas do zapadlosti	Hipotetična pozicija v netveganem dolžniškem VP			Faktor (v %)	Vrednost
	Dolga	Kratka	Neto		
1	2	3	4=2-3	5	6=4x5/100
0 do vključno 3 mes.				0,2	
3 do vključno 6 mes.				0,4	
6 do vključno 12 mes.				0,7	
1 do vključno 2 leti				1,25	
2 do vključno 3 leta				1,75	
3 do vključno 4 leta				2,25	
4 do vključno 5 let				2,75	
več kot 5 let				3,75	
Kapitalska zahteva za implicitno obrestno tveganje				Skupaj =	

III. SKUPNA KAPITALSKA ZAHTEVA = Kapitalska zahteva za posebno pozicijsko tveganje +
Kapitalska zahteva za splošno pozicijsko tveganje + Kapitalska zahteva za implicitno obrestno tveganje =