

III. Izračun presežne izpostavljenosti

v tisoč SIT

Izpostavljenost		Znesek
1		2
1. Neto izpostavljenost iz postavk trgovanja	utež	
_____	_____	
_____	_____	
_____	_____	
2. Prosti kapital		
3. Presežna izpostavljenost = 1 - 2	utež	
_____	_____	
_____	_____	
_____	_____	
Skupaj =		_____

IV. Izračun kapitalske zahteve

- a) Presežna izpostavljenost obstaja 10 dni ali manj
Kapitalska zahteva = _____
- b) Presežna izpostavljenost obstaja 10 dni ali več
Kapitalska zahteva = _____

V. SKUPNA DODATNA KAPITALSKA ZAHTEVA = _____

- Tabeli I. in II. ter izračuna pod III. in IV. se izpolnjujejo za vsako preseganje omejitev izpostavljenosti iz naslova trgovanja posebej.
- Banka v tabeli I. pod 1 navede znesek omejitve izpostavljenosti, pri kateri je prišlo do preseganja (25% K, 800% K...)
- Banka v tabeli II. navede dolge in kratke pozicije oz. izpostavljenosti, ki sestavljajo izpostavljenost iz postavk trgovanja, v naraščajočem vrstnem redu glede na njihove uteži za posebno pozicijsko tveganje in/ali tveganje neizpolnitve nasprotne stranke. Pri vsaki izpostavljenosti / poziciji banka navede njen izvor (vrsta VP, izvedenega finančnega instrumenta, ipd.), pripadajočo utež in znesek.
- Banka pri ugotavljanju neto dolgih pozicij / izpostavljenosti v tabeli II. odšteva skupni znesek kratkih pozicij od tistih dolgih pozicij / izpostavljenosti, ki jim ustreza najvišja utež za posebno pozicijsko tveganje in / ali tveganje neizpolnitve nasprotne stranke.
- Banka pri ugotavljanju presežne izpostavljenosti pod 3 v tabeli III. odšteje prosti kapital od tistih pozicij / izpostavljenosti, navedenih pod 1, ki jim pripada najnižja utež za posebno pozicijsko tveganje in / ali tveganje neizpolnitve nasprotne stranke. Znesek pod Skupaj je vsota pozicij / izpostavljenosti, zmanjšanih za znesek prostega kapitala ter preostalih pozicij / izpostavljenosti (oz. PRESEŽNA IZPOSTAVLJENOST).
- Banka v izračunu pod IV. upošteva določila sklepa o kapitalski ustreznosti (34.2. točka).
- Znesek skupne dodatne kapitalske zahteve pod V. je enak vsoti kapitalskih zahtev za tveganje preseganja velikih izpostavljenosti na podlagi trgovanja do različnih oseb ali skupin povezanih oseb. Znesek skupne dodatne kapitalske zahteve se vpiše v obrazec KAP-trg 2 pod VI/4.