

VALUTNIM TVEGANJEM PRILAGOJENE POSTAVKE
na dan _____

v tisoč SIT

		PROMPTNA POZICIJA				TERMINSKA POZICIJA			Opcije	Skupaj pozicija	Srednji tečaj BS ali tržni tečaj	
Šifra valute	Oznaka valute	Bilančne postavke			Zunajbilančne postavke	Skupaj	Terjatve	Obveznosti				Neto
		Aktiva	Pasiva	Neto								
		1	2	3=(1-2)	4	*5=(3+4)	6	7	*8=(6-7)	*9	*10=(5+8+9)	11
978	EUR											
840	USD											
756	CHF											
...												
...												
...												
...												
...												
...												
Izračun - točka 17: SKUPAJ VSOTA DOLGIH POZICIJ SKUPAJ VSOTA KRATKIH POZICIJ SKUPAJ VALUTNIM TVEGANJEM PRILAGOJENE POSTAVKE (večja vsota) Izračun za kapitalsko zahtevo - točka 18:												

* + = dolga pozicija, - = kratka pozicija

V stolpcu 5 (Skupaj) se zneski iz stolpca 4 (Zunajbilančne postavke) upoštevajo z negativnim predznakom, saj gre za potencialne obveznosti banke.

Swap z BS:
(evidenčni podatek)

- odkupni
- prodajni