

CR SA

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA KREDITNO TVEGANJE, KREDITNO TVEGANJE NASPROTNE STRANKE IN TVEGANJE ZARADI ČASOVNE NEUSKLAJENOSTI PLAČILA IN IZROČITVE PO STANDARDIZIRANEM PRISTOPU

SA / IRB kategorija izpostavljenosti:

Imenovane ECAI in/ali ECA:

v tisoč EUR

	ORIGINALNA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI PRED UPORABO KONVERZJSKIH FAKTORJEV	OSLABITVE IN REZERVACIJE, POVEZANE Z ORIGINALNO IZPOSTAVLJENOSTJO	NETO VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI	KREDITNA ZAVAROVANJA Z UČINKOM ZAMENJAVE NA IZPOSTAVLJENOST							NETO IZPOSTAVLJENOST PO UPORABI KONVERZJSKIH FAKTORJEV	KREDITNA ZAVAROVANJA, KI UČINKUJEJO NA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI RAZVITA METODA ZA ZAVAROVANJE S FINANČNIM PREMOŽENJEM			POLNO PRILAGOJENA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI (E*)	RAZVRSTITEV POLNO PRILAGOJENIH VREDNOSTI ZUNAJBILANČNIH POSTAVK GLEDE NA KONVERZJSKE FAKTORJE				VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI	TVEGANJEM PRILAGOJEN ZNESEK IZPOSTAVLJENOSTI	KAPITALSKA ZAHTEVA																			
				OSEBNA KREDITNA ZAVAROVANJA PRILAGOJENE VREDNOSTI (G ₁)		STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJA		ZAMENJAVA IZPOSTAVLJENOSTI ZARADI KREDITNEGA ZAVAROVANJA				VREDNOST PRILAGODITVE ZA NESTANOVITNOST IZPOSTAVLJENOSTI	ZAVAROVANJE S FINANČNIM PREMOŽENJEM:			PRILAGODITVE ZA NESTANOVITNOST IN ZAPADLOST	0%	20%	50%				100%																		
				OSEBNA JAMSTVA	KREDITNI IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI	FINANČNO PREMOŽENJE: ENOSTAVNA METODA	DRUGA STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJA	CELOTNI ODLIVI	CELOTNI PRILIVI	ZAVAROVANJE S FINANČNIM PREMOŽENJEM:			PRILAGODITVE ZA NESTANOVITNOST IZPOSTAVLJENOSTI																												
1	2	3	4=1-3	5	6	7	8	9	10	11=4-9+10	12	13	14	15=11+12-13	16	17	18	19	20=15-16-0,8*17-0,5*18	21	22=21*8%																				
SKUPAJ																						Povezava z obrazcem CA																			
RAZČLENITEV SKUPNE IZPOSTAVLJENOSTI GLEDE NA TIP IZPOSTAVLJENOSTI:																																									
Postavke sredstev																																									
Zunajbilančne postavke																																									
Posli financiranja vrednostnih papirjev in posli z dolgim rokom poravnave																																									
Izvedeni finančni instrumenti																																									
Pogodbeni pobot med različnimi kategorijami produktov																																									
RAZČLENITEV SKUPNE IZPOSTAVLJENOSTI GLEDE NA UTEŽI TVEGANJA:																																									
0%																																									
10%																																									
20%																																									
35%																																									
50%																																									
od tega: <i>zapadle postavke (a)</i>																																									
<i>brez bonitetne ocene imenovane ECAI</i>																																									
<i>zavarovano s poslovnimi nepremičninami (a)</i>																																									
75%																																									
100%																																									
od tega: <i>zapadle postavke (a)</i>																																									
<i>brez bonitetne ocene imenovane ECAI</i>																																									
<i>zavarovano z nepremičninami (a)</i>																																									
150%																																									
od tega: <i>zapadle postavke (a)</i>																																									
<i>brez bonitetne ocene imenovane ECAI</i>																																									
200%																																									
Druga uteži tveganja																																									

(a) Izpolni banka, ki ima dovoljenje Banke Slovenije za uporabo pristopa IRB.