CR SEC SA

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA KREDITNO TVEGANJE PRI LISTINJENJU PO STANDARDIZIRANEM PRISTOPU

Vrsta listinjenja:

Imenovane ECAI:

v tisoč EUR

	SKUPNA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI V LISTINJENJU	SINTETIČNO LISTINJENJE: KREDITNO ZAVAROVANJE IZPOSTAVLJENOSTI V LISTINJENJU			POZICIJE V LISTINJENJU	(-) OSLABITVE IN REZERVACIJE	NETO VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI Z UPOŠTEVANJEM OSLABITEV IN REZERVACIJ	KREDITNA ZAVAROVANJA Z UČINKOM ZAMENJAVE NA IZPOSTAVLJENOST				NETO VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI PO KREDITNIH ZAVAROVANJI H Z UČINKOM ZAMENJAVE IN PRED UPORABO KONVERZIJSKIH KOLIČINKOV	(-) KREDITNA ZAVAROVANJA, KI UČINKUJEJO NA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI RAZVITA METODA ZA ZAVAROVANJE S FINANČNIM PREMOŽENJEM (Cvam)	POLNO PRILAGOJENA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI (E*)	RAZVRSTITEV POLNO PRILAGOJENIH VREDNOSTI ZUNAJBILANČNIH POSTAVK (E*) GLEDE NA KONVERZIJSKE KOLIČINKE							RAZVRSTITEV VREDNOSTI IZPOSTAVLJENOSTI GLEDE NA UTEŽI TVEGANJA								TVEGANJEM PRILAGOJENI ZNESEK IZPOSTAVLJENOSTI	PRILAGODITEV TVEGANJEM PRILAGOJENEGA ZNESKA IZPOSTAVLJENOSTI	SKUPNA KAPITALSKA ZAHTEVA PRED UPORABO CAP	MEMORANDUMSKE POSTAVKE: KAPITALSKE ZAHTEVE, KI USTREZAJO ODLIVOM LISTINJENJA PO SA PRISTOPU V DRUGE RAZREDE IZPOSTAVLJENOSTI	SKUPNA KAPITALSKA ZAHTEVA PO UPORABI CAP
		(-) STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJA (Cvam)	(-) SKUPAJ ODLIVI	VREDNOST ZADRŽANI H ALI REODKUPL JENIH KREDITNIH ZAVAROVANJ	VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI V LISTINJENJU PRED PRED KONVERZIJSKIMI KOLIČNIKI			OSEBNA KREDITNA ZAVAROVANJA - PRILAGOJENE VREDNOSTI (Ga)	STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJA	ZAMENJAVA IZPOSTAVLJENOSTI ZARADI KREDITNIH ZAVAROVANJ					0%	>0% IN <=20%	>20% IN <=50%	>50% IN <=100%	VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI	(-) ODBITNE POSTAVKE OD KAPITALA	VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI, KI SE JI DODELI UTEŽ TVEGANJA	OCENJENA IZPOSTAVLJENOST (STOPNJE KREDITNE KAKOVOSTI OD 1 DO 4)				1250%		IZPOSTAVLJENOST Z UTEŽMI TVEGANJA IZ SKUPINE OSNOVNE IZPOSTAVLJENOSTI						
		OSEBNA KREDITNA ZAVAROVANJA - PRILAGOJENE VREDNOSTI (Ga)								(-) SKUPAJ ODLIVI	SKUPAJ PRILIVI											20%	50%	100%	350%	OCENJENA IZPOSTAVLJENOST	NEOCENJENA IZPOSTAVLJENOST		OD KATERIH TRANŠA 2 IZGUBE V ABCP				
	1	2	3	4	5	6	7=5+6	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21=19+20	22	23	24	25	26	27	28	29	30	30 bis	31	32	33
SKUPNA IZPOSTAVLJENOST																																		**Povezava z obrazcem CA**
A. IZVORNA BANKA: SKUPNA IZPOSTAVLJENOST																																		
1. POSTAVKE SREDSTEV																																		
1.1. NAJVIŠJA POSTAVKA KREDITNEGA TVEGANJA																																		
1.2. VMESNA POSTAVKA KREDITNEGA TVEGANJA																																		
1.3. POSTAVKA PRVE IZGUBE																																		
2. ZUNAJBILANČNE POSTAVKE IN IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI																																		
3. OBNAVLJAJOČE SE IZPOSTAVLJENOSTI Z MOŽNOSTJO PREDČASNEGA ODPLAČILA																																		
B. INVESTITOR: SKUPNA IZPOSTAVLJENOST																																		
1. POSTAVKE SREDSTEV																																		
1.1. NAJVIŠJA POSTAVKA KREDITNEGA TVEGANJA																																		
1.2. VMESNA POSTAVKA KREDITNEGA TVEGANJA																																		
1.3. POSTAVKA PRVE IZGUBE																																		
2. ZUNAJBILANČNE POSTAVKE IN IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI																																		
C. SPONZOR: SKUPNA IZPOSTAVLJENOST																																		
1. POSTAVKE SREDSTEV																																		
2. ZUNAJBILANČNE POSTAVKE IN IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI																																		