

MKR SA TDI

## IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA POZICIJSKO TVEGANJE DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTOV PO STANDARDIZIRANEM PRISTOPU

Valuta:

v tisoč EUR

	POZICIJE							UTEŽ (%)	KAPITALSKA ZAHTEVA	
	POSAMEZNA POZICIJA		(+/-) UČINEK ZMANJŠANJA POZICIJE, KI IZHAJA IZ PRVE PRODAJE DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTOV Z OBVEZNOSTJO ODKUPA	NETO POZICIJA		(-) ZMANJŠANJE ZARADI POZICIJ TRGOVALNE KNJIGE, KI SO VAROVANE S KREDITNIMI IZVEDENIMI FINANČNIMI INSTRUMENTI				POZICIJE, KI SO PREDMET KAPITALSKE ZAHTEVE
	DOLGA	KRATKA		DOLGA	KRATKA	DO NETO DOLGE POZICIJE	DO NETO KRATKE POZICIJE			
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)		
<b>DOLŽNIŠKI FINANČNI INSTRUMENTI V TRGOVALNI KNJIGI</b>									Povezava z obrazcem GA	
1 Splošno pozicijsko tveganje: pristop, ki temelji na zapadlosti (*)										
1.1 Skupina razredov zapadlosti 1										
0 ≤ 1 meseca (x1)										
> 1 ≤ 3 mesecev (x2)										
> 3 ≤ 6 mesecev (x3)										
> 6 ≤ 12 mesecev (x4)										
1.2 Skupina razredov zapadlosti 2										
> 1 ≤ 2 (1,9 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x5)										
> 2 ≤ 3 (> 1,9 ≤ 2,8 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x6)										
> 3 ≤ 4 (> 2,8 ≤ 3,6 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x7)										
1.3 Skupina razredov zapadlosti 3										
> 4 ≤ 5 (> 3,6 ≤ 4,3 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x8)										
> 5 ≤ 7 (> 4,3 ≤ 5,7 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x9)										
> 7 ≤ 10 (> 5,7 ≤ 7,3 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x10)										
> 10 ≤ 15 (> 7,3 ≤ 9,3 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x11)										
> 15 ≤ 20 (> 9,3 ≤ 10,6 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x12)										
> 20 (> 10,6 ≤ 12,0 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x13)										
(> 12,0 ≤ 20,0 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x14)										
(> 20 za obrestno mero manjšo od 3%) let (x15)										
1.a Izravnana tehtana pozicija iz vseh skupin razredov zapadlosti (A)								10,00		
1.b Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 1 (B)								40,00		
1.c Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 2 (C)								30,00		
1.d Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 3 (D)								30,00		
1.e1 Izravnana tehtana pozicija med skupinama razredov zapadlosti 1 in 2 (E)								40,00		
1.e2 Izravnana tehtana pozicija med skupinama razredov zapadlosti 2 in 3 (F)								40,00		
1.f Izravnana tehtana pozicija med skupinama razredov zapadlosti 1 in 3 (H)								150,00		
1.g Preostale neizravnane tehtane pozicije (G)								100,00		
2 Splošno pozicijsko tveganje: pristop, ki temelji na trajanju (**)										
2.1 Skupina 1 (0 ≤ 1,0 leta)										
2.2 Skupina 2 (>1,0 do ≤ 3,6 let)										
2.3 Skupina 3 (> 3,6 let)										
2.a Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, iz vseh skupin (A)								2,00		
2.b1 Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 1 in 2 (B)								40,00		
2.b2 Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 2 in 3 (C)								40,00		
2.c Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 1 in 3 (D)								150,00		
2.d Preostale neizravnane pozicije, tehtane s trajanjem (E)								100,00		
3 Posebno pozicijsko tveganje										
3.1 Dolžniški finančni instrumenti prve kategorije								0,00		
3.2 Dolžniški finančni instrumenti druge kategorije										
3.2.a S preostalo zapadlostjo ≤ 6 mesecev								0,25		
3.2.b S preostalo zapadlostjo > 6 mesecev in ≤ 24 mesecev								1,00		
3.2.c S preostalo zapadlostjo > 24 mesecev								1,60		
3.3 Dolžniški finančni instrumenti tretje kategorije								8,00		
3.4 Dolžniški finančni instrumenti četrte kategorije								12,00		
3.5 Lestjine izpostavljenosti, ki so predmet tehtanja z utežjo 1250% ali zmanjšani in likvidnostni aranžmaji brez bonitetne ocene										
4 Pristop za pozicijsko tveganje za pozicije v enotah premoženja CIU										
5 Pristop, ki temelji na kritiju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se trguje na priznanih borzah										
6 Pristop, ki temelji na kritiju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se trguje na prostem trgu (OTC)										
7 Druga ne-delta tveganja (gama in vega) povezana z opcijami										

(\*) Oznake na desni strani se nanašajo na obrazec MKR SA TDI-a

(\*\*) Oznake na desni strani se nanašajo na obrazec MKR SA TDI-b