

MKR SA TDI - a

**IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA SPLOŠNO TVEGANJE
PRI DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTIH (pristop, ki temelji na zapadlosti)**

Izračun tehtanih pozicij, izravnavanje po razredih in skupinah ter izračun kapitalne zahteve

Valuta:

v tisoč EUR

Skupina	Razred	Posamezna neto pozicija		Utež (v %)	Tehtana neto pozicija		Po razredih		Po skupinah		Med skupinami			
		(iz MKR SA TDI, vrstice od 1.1 do 1.3)			Dolga	Kratka	Izravnano	Neizravnano	Izravnano	Neizravnano	Izravnano			
		Dolga	Kratka											
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13		
1	x1			0,00%								Sk. 1 in 2	Sk. 1 in 3 H	
1	x2			0,20%					B					
1	x3			0,40%										
1	x4			0,70%										
2	x5			1,25%							E			
2	x6			1,75%					C					
2	x7			2,25%										
3	x8			2,75%								Sk. 2 in 3		
3	x9			3,25%								F		
3	x10			3,75%										
3	x11			4,50%					D					
3	x12			5,25%										
3	x13			6,00%										
3	x14			8,00%										
3	x15			12,50%										

Skupaj

A

G

Skupna kapitalna zahteva = 10% A + 40% B + 30% (C+D) + 40% (E+F) + 100% G + 150% H = _____

Tabela se izpolni za vsako valuto posebej.