

MKR SA TDI - b

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

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

Valuta:

v tisoč EUR

Skupina	Posamezna neto pozicija <small>(iz MKR SA TDI, vrstice od 2.1 do 2.3)</small>		Domnevana sprememba obrestne mere (v %)	Modificirano trajanje v letih	Tehtana neto pozicija		Po skupinah		Med skupinami		
	Dolga	Kratka			Dolga	Kratka	Izravnano	Neizravnano	Izravnano		
	2	3			4	5	6=2x4x5	7=3x4x5	8	9	10
1 <small>(0 ≤ 1,0 leta)</small>			1,00							Sk. 1 in 2	
2 <small>(&gt;1,0 do ≤ 3,6 let)</small>			0,85							B	Sk 1 in 3
3 <small>(&gt; 3,6 let)</small>			0,70							Sk. 2 in 3	D
										C	

Skupaj \_\_\_\_\_

A                      E

Skupna kapitalna zahteva = 2% A + 40% (B+C) + 150% D + 100% E = \_\_\_\_\_

Tabela se izpolni za vsako valuto posebej.