MKR SA FX

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA VALUTNO TVEGANJE PO STANDARDIZIRANEM PRISTOPU

v tisoč EUR

	POSAMEZNA POZICIJA				NETO POZICIJA		POZICIJE, KI SO PREDMET KAPITALSKE ZAHTEVE			UTEŽ (%)			KAPITALSKA ZAHTEVA
	DOLGA	KRATKA	Memorandumske postavke: Varovane pozicije za kapitalski količnik										
			Dolga	Kratka	DOLGA	KRATKA	DOLGA	KRATKA	IZRAVNANO	DOLGA	KRATKA	IZRAVNANO	
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)				(10)
SKUPNA VALUTNA POZICIJA													Povezava z obrazcem CA
1 Valute vključene v drugo fazo EMU												**1,6**	
2 Valute, ki so predmet medvladnih dogovorov													
3 Valute v tesni soodvisnosti												**4,00**	
4 Vse druge valute (vključno s pozicijami CIU v tujih valutah, obravnavane kot ločene valute)										**8,00**	**8,00**		
5 Zlato										**8,00**	**8,00**		
6 Druga tveganja ne-delta (gama in vega, povezana z opcijami na tujo valuto													
Memorandumske postavke: pozicije v tujih valutah													
EUR													
Valute vključene v ERM2													
DKK													
EEK													
LTL													
CYP													
LVL													
MTL													
SKK													
GBP													
SEK													
CHF													
Druge valute držav članic evropskega gospodarskega območja													
USD													
CAD													
AUD													
JPY													
Druge valute držav nečlanic evropskega gospodarskega območja													
Pozicije CIU v tujih valutah, obravnavane kot ločene valute													