MKR SA COM

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA TVEGANJE SPREMEMB CEN BLAGA PO STANDARDIZIRANEM PRISTOPU

Blago:

v tisoč EUR

	POSAMEZNA POZICIJA				NETO POZICIJA		POZICIJE, KI SO PREDMET KAPITALSKE ZAHTEVE	UTEŽ (%)	KAPITALSKA ZAHTEVA
	DOLGA	KRATKA	MEMORANDUMSKE POSTAVKE: Pozicije iz financiranja blaga						
			Dolga	Kratka	DOLGA	KRATKA			
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)		(8)
SKUPNE POZICIJE V BLAGU									Povezava z obrazcem CA
1 Pristop lestvice zapadlosti									
1.1 Skupina razredov zapadlosti do 1 leta									
0 ≤ 1 meseca									
> 1 ≤ 3 mesecev									
> 3 ≤ 6 mesecev									
> 6 ≤ 12 mesecev									
1.2 Skupina razredov zapadlosti nad 1 letom in do vključno 3 let									
> 1 ≤ 2 let									
> 2 ≤ 3 let									
1.3 Skupina razredov zapadlosti nad 3 leti									
1.a Izravnane dolge in kratke pozicije znotraj vsakega razreda zapadlosti								**1,50**	
1.b Izravnane pozicije med dvema razredoma zapadlosti								**0,60**	
1.c Preostale neizravnane pozicije								**15,00**	
2 Razširjen pristop lestvice zapadlosti									
2.1 Skupina razredov zapadlosti do 1 leta									
0 ≤ 1 meseca									
> 1 ≤ 3 mesecev									
> 3 ≤ 6 mesecev									
> 6 ≤ 12 mesecev									
2.2 Skupina razredov zapadlosti nad 1 letom in do vključno 3 let									
> 1 ≤ 2 let									
> 2 ≤ 3 let									
2.3 Skupina razredov zapadlosti nad 3 leti									
2.a Izravnane dolge in kratke pozicije znotraj vsakega razreda zapadlosti									
2.b Izravnane pozicije med dvema razredoma zapadlosti									
2.c Preostale neizravnane pozicije									
3 Enostavni pristop: Vse pozicije									
3.a /Neto pozicije								**15,00**	
3.b Bruto pozicije								**3,00**	
4 Pristop, ki temelji na kritju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi s trguje na priznanih borzah									
5 Pristop, ki temelji na kritju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se trguje na prostem trgu (OTC)									
6 Druga ne-delta tveganja za opcije na blago									
7 Tveganje likvidnosti									