

MKR IM

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA POZICIJSKO TVEGANJE, VALUTNO TVEGANJE IN/ALI TVEGANJE SPREMEMB CEN BLAGA Z UPORABO NOTRANJIH MODELOV

v tisoč EUR

	MULTIPLIKACIJSKI FAKTOR x POVPREČJE ZA VaR ZA PRETEKLIH 60 DELOVNIH DNI	VaR PREJŠNJEGA DNE	DODATNA KAPITALSKA ZAHTEVA ZA POSEBNO TVEGANJE	DODATNA KAPITALSKA ZAHTEVA ZARADI TVEGANJA NEPLAČILA	KAPITALSKA ZAHTEVA	Memorandumske postavke:	
						Število preseganj v zadnjih 250 delovnih dnevih	Multiplikacijski faktor
						(1)	(2)
SKUPNE POZICIJE					Povezava z obrazcem CA		
Memorandum postavk: razstavljanje vsakega posameznega tržnega tveganja							
1 Dolžniški finančni instrumenti							
1.1 Splošno tveganje							
1.2 Posebno tveganje							
2 Lastniški finančni instrumenti							
2.1 Splošno tveganje							
2.2 Posebno tveganje							
3 Valutno tveganje							
4 Tveganje spremembe cen blaga							
5 Skupna vrednost splošnega tveganja							
6 Skupna vrednost posebnega tveganja							