

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA POZICIJSKO TVEGANJE DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTOV PO STANDARDIZIRANEM PRISTOPU

□ □ □ □ □

			POZICIJE						UTEŽ (%)	KAPITALSKA ZAHTEVA		
			POSAMEZNA POZICIJA		(1) UČINEK ZMANJŠANJA POZICIJE, KI IZHAJA IZ PRVE PRODAJE DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTOV Z OBVEZNOSTJO ODKUPA	NETO POZICIJA		(2) ZMANJŠANJE ZARADI POZICIJO TRGOVALNE KNJIGE, KI SO VAROVANE S KREDITNIMI IZVEDENIMI FINANČNIH INSTRUMENTI			POZICIJE, KI SO PREDMET KAPITALSKE ZAHTEVE	
			DOLGA	KRATKA		DOLGA	KRATKA	DO NETO DOLGE POZICIJE				DO NETO KRATKE POZICIJE
			(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	
DOLŽNIŠKI FINANČNI INSTRUMENTI V TRGOVALNI KNJIGI												
1 Splošno pozicijsko tveganje: pristop, ki temelji na zapadlosti (*)												
1.1 Skupina razredov zapadlosti 1												
0 ≤ 1 meseca	(x1)											
> 1 ≤ 3 mesecev	(x2)											
> 3 ≤ 6 mesecev	(x3)											
> 6 ≤ 12 mesecev	(x4)											
1.2 Skupina razredov zapadlosti 2												
> 1 ≤ 2 (1,9 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x5)											
> 2 ≤ 3 (> 1,9 ≤ 2,8 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x6)											
> 3 ≤ 4 (> 2,8 ≤ 3,6 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x7)											
1.3 Skupina razredov zapadlosti 3												
> 4 ≤ 5 (> 3,6 ≤ 4,3 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x8)											
> 5 ≤ 7 (> 4,3 ≤ 5,7 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x9)											
> 7 ≤ 10 (> 5,7 ≤ 7,3 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x10)											
> 10 ≤ 15 (> 7,3 ≤ 9,3 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x11)											
> 15 ≤ 20 (> 9,3 ≤ 10,6 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x12)											
> 20 (> 10,6 ≤ 12,0 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x13)											
> 12,0 ≤ 20,0 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x14)											
> 20 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let	(x15)											
1.a Izravnana tehtana pozicija iz vseh skupin razredov zapadlosti	(A)									10,00		
1.b Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 1	(B)									40,00		
1.c Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 2	(C)									30,00		
1.d Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 3	(D)									30,00		
1.e1 Izravnana tehtana pozicija med skupinama razredov zapadlosti 1 in 2	(E)									40,00		
1.e2 Izravnana tehtana pozicija med skupinama razredov zapadlosti 2 in 3	(F)									40,00		
1.f Izravnana tehtana pozicija med skupinama razredov zapadlosti 1 in 3	(H)									150,00		
1.g Preostale neizravnane tehtane pozicije	(G)									100,00		
2 Splošno pozicijsko tveganje: pristop, ki temelji na trajanju (**)												
2.1 Skupina 1	(0 ≤ 1,0 leta)											
2.2 Skupina 2	(>1,0 do ≤ 3,6 let)											
2.3 Skupina 3	(> 3,6 let)											
2.a Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, iz vseh skupin	(A)									2,00		
2.b1 Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 1 in 2	(B)									40,00		
2.b2 Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 2 in 3	(C)									40,00		
2.c Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 1 in 3	(D)									150,00		
2.d Preostale neizravnane pozicije, tehtane s trajanjem	(E)									100,00		
3 Posebno pozicijsko tveganje												
3.1 Dolžniški finančni instrumenti prve kategorije												
3.2 Dolžniški finančni instrumenti druge kategorije												
3.2.a S preostalo zapadlostjo ≤ 6 mesecev										0,25		
3.2.b S preostalo zapadlostjo > 6 mesecev in ≤ 24 mesecev										1,00		
3.2.c S preostalo zapadlostjo > 24 mesecev										1,60		
3.3 Dolžniški finančni instrumenti tretje kategorije												
3.4 Dolžniški finančni instrumenti četrte kategorije												
3.5 Listinjene izpostavljenosti, ki so predmet tehtanja z utežjo 1												

(**) Oznake na desni strani se nanašajo na obrabe MKR SA TDI-b