

MKR SA EQU
Trg:

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

v tisoč EUR

	POZICIJE						UTEŽ (%)	KAPITALSKA ZAHTEVA
	POSAMEZNA POZICIJA		(-) UČINEK ZMANJŠANJA POZICIJE, KI IZHAJA IZ PRVE PRODAJE LASTNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTOV Z OBVEZNOSTJO ODKUPA	NETO POZICIJA		POZICIJE, KI SO PREDMET KAPITALSKE ZAHTEVE		
	DOLGA	KRATKA		DOLGA	KRATKA			
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)		(7)
LASTNIŠKI FINANČNI INSTRUMENTI V TRGOVALNI KNJIGI								
1 Splošno pozicijsko tveganje							8,00	Povezava z obrazcem CA
1.1 Terminske pogodbe na delniške indekse, ki so predmet posebne obravnave								
1.2 Drugi lastniški finančni instrumenti, razen terminskih pogodb na delniške indekse								
2 Posebno pozicijsko tveganje								
2.1 Visoko kvalitetni, likvidni in široko razpršeni portfelji, ki so predmet nižjih kapitalskih zahtev							2,00	
2.2 Drugi lastniški finančni instrumenti (razen visoko kvalitetnih, likvidnih in široko razpršenih portfeljev)							4,00	
3 Pristop za pozicijsko tveganje za pozicije v enotah premoženja CIU								
4 Pristop, ki temelji na kritju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se 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-delata tveganja (gama in vega) za opcije								