

MKR IM

## IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA POZICIJSKO TVEGANJE, VALUTNO TVEGANJE IN/ALI TVEGANJE SPREMENB CEN BLAGA Z UPORABO NOTRANJNH MODELOV

v tisoč EUR

|                                                                           | MULTIPLIKACIJSKI<br>FAKTOR x<br>POVPREČJE ZA<br>VaR ZA<br>PRETEKLIH 60<br>DELOVNIH DNI | VaR PREJŠNJEGA<br>DNE | DODATNA<br>KAPITALSKA<br>ZAHTEVA ZA<br>POSEBNO<br>TVEGANJE | DODATNA<br>KAPITALSKA<br>ZAHTEVA ZARADI<br>TVEGANJA<br>NEPLAČILA | KAPITALSKA<br>ZAHTEVA        | Memorandumske postavke:                               |                            |
|---------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------|------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------------------|
|                                                                           |                                                                                        |                       |                                                            |                                                                  |                              | Število preseganj v<br>zadnjih 250<br>delovnih dnevih | Multiplikacijski<br>faktor |
|                                                                           | (1)                                                                                    | (2)                   | (3)                                                        | (4)                                                              | (5)=Max<br>[(1).(2)]+(3)+(4) | (6)                                                   | (7)                        |
| <b>SKUPNE POZICIJE</b>                                                    |                                                                                        |                       |                                                            |                                                                  | Povezava z obrazcem CA       |                                                       |                            |
| Memorandum postavk: razstavljanje<br>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                                      |                                                                                        |                       |                                                            |                                                                  |                              |                                                       |                            |