

MKR SA TDI - b

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA SPLOŠNO TVEGANJE
PRI DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTIH (pristop, ki temelji na trajanju)

Izračun tehtanih pozicij, izravnavanje po razredih in skupinah ter izračun kapitalске zahteve:

Valuta:

v tisoč EUR

Skupina	Posamezna neto pozicija		Domnevana sprememba obrestne mere (v %)	Modificirano trajanje v letih	Tehtana neto pozicija		Po skupinah		Med skupinami	
	(iz MKR SA TDI, vrstice od 2.1 do 2.3)				Dolga	Kratka	Izravnano	Neizravnano	Izravnano	
	Dolga	Kratka								
1	2	3	4	5	6=2x4x5	7=3x4x5	8	9	10	11
1 (0 ≤ 1,0 leta)			1,00						Sk. 1 in 2 B	Sk 1 in 3 D
2 (>1,0 do ≤ 3,6 let)			0,85							
3 (> 3,6 let)			0,70						Sk. 2 in 3 C	

Skupaj _____ A E

Skupna kapitalska zahteva = 2% A + 40% (B+C) + 150% D + 100% E = _____

Tabela se izpolni za vsako valuto posebej.