

IZRAČUN KAPITALSKES ZAHTEVE ZA KREDITNO TVEGANJE IN KREDITNO TVEGANJE NASPROTNE STRANKE PO STANDARDIZIRANEM PRISTOPU

--	--

	ORIGINALNA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI PRED UPORABO KONVERZIJSKIH FAKTORJEV		OSLABITVE, POVEZANE Z ORIGINALNO IZPOSTAVLJE-NOSTJO	NETO VREDNOST IZPOSTAVLJE-NOSTI	KREDITNA ZAVAROVANJA Z UČINKOM ZAMENJAVE NA IZPOSTAVLJENOST						NETO IZPOSTAVLJE-NOST PO UPOŠTEVANJU CRM IN PRED UPORABO KONVERZIJSKIH FAKTORJEV	KREDITNA ZAVAROVANJA, KI UČINKUJEJO NA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI: RAZVITA METODA ZA ZAVAROVANJE S FINANČNIM PREMOŽENJEM			POLNO PRILAGOJENA VREDNOST IZPOSTAVLJE-NOSTI (E*)	RAZVRSTITEV POLNO PRILAGOJENIH VREDNOSTI ZUNAJBILANČNIH POSTAVK GLEDE NA KONVERZIJSKE FAKTORJE				VREDNOST IZPOSTAVLJE-NOSTI	TVEGANJEM PRILAGOJEN ZNESEK IZPOSTAVLJEN OSTI	KAPITALSKA ZAHTEVA
	OD TEGA: IZ NASLOVA KREDITNEGA TVEGANJA NASPROTNE STRANKE (CRR)				OSEBNA KREDITNA ZAVAROVANJA: PRILAGOJENE VREDNOSTI (G)		STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJA		ZAMENJAVA IZPOSTAVLJENOSTI ZARADI KREDITNEGA ZAVAROVANJA			NESTANOVIT-NOSTI PRILAGOJENA VREDNOST IZPOSTAVLJE-NOSTI	ZAVAROVANJE S FINANČNIM PREMOŽENJEM : PRILAGOJENA VREDNOST (Cvsm)	PRILAGODITVE ZA NESTANOVIT-NOSTI IN ZAPADLOST		0%	20%	50%	100%			
					OSEBNA JAMSTVA	KREDITNI IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI	FINANČNO PREMOŽENJE: ENOSTAVNA METODA	DRUGA STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJA	CELOTNI ODLIVI	CELOTNI PRILIVI												
	1	2	3	4=1-3	5	6	7	8	9	10	11=4-9+10	12	13	14	15=11+12-13	16	17	18	19	20=15-16-0,8*17-0,5*18	21	22
SKUPAJ																						Povezava z obrazcem CA
RAZČLENITEV SKUPNE IZPOSTAVLJENOSTI GLEDE NA TIP IZPOSTAVLJENOSTI:																						
Postavke sredstev																						
Zunajbilančne postavke																						
Posli financiranja vrednostnih papirjev in posli z dolgim rokom poravnave																						
Izvedeni finančni instrumenti																						
Pogodbeni pobot med različnimi kategorijami produktov																						
RAZČLENITEV SKUPNE IZPOSTAVLJENOSTI GLEDE NA UTEŽI TVEGANJA:																						
0%																						
10%																						
20%																						
35%																						
50%																						
od tega: zapadle postavke (a)																						
brez bonitetne ocene imenovane ECAI																						
zavarovano s poslovnimi nepremičninami (a)																						
75%																						
100%																						
od tega: zapadle postavke (a)																						
brez bonitetne ocene imenovane ECAI																						
zavarovano z nepremičninami (a)																						
150%																						
od tega: zapadle postavke (a)																						
200%																						
Druge uteži tveganja																						

(a) Izpolni borznoposredniška družba, ki ima dovoljenje Banke Slovenije za uporabo pristopa IRB