**CR SEC SA**

## IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA KREDITNO TVEGANJE PRI LISTINJENJU PO STANDARDIZIRANEM PRISTOPU

**Vrsta listinjenja:**

**Imenovane ECAI:**

v tisoč EUR

| | SKUPNA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI V LISTINJENJU | SINTETIČNO LISTINJENJE: KREDITNO ZAVAROVANJE IZPOSTAVLJENOSTI V LISTINJENJU | | | POZICIJE V LISTINJENJU | (-) OSLABITVE IN REZERVACIJE | NETO VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI Z UPOŠTEVANJEM OSLABITEV IN REZERVACIJ | KREDITNA ZAVAROVANJA Z UČINKOM ZAMENJAVE NA IZPOSTAVLJENOST | | | | NETO VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI PO KREDITNIH ZAVAROVANJIH Z UČINKOM ZAMENJAVE IN PRED UPORABO KONVERZIJSKIH KOLIČINKOV | (-) KREDITNA ZAVAROVANJA, KI UČINKUJEJO NA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI : RAZVITA METODA ZA ZAVAROVANJE S FINANČNIM PREMOŽENJEM (Ovam) | POLNO PRILAGOJENA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI (E*) | RAZVRSTITEV POLNO PRILAGOJENIH VREDNOSTI ZUNAJBILANČNIH POSTAVK (E*) GLEDE NA KONVERZIJSKE KOLIČINKE | | | | VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI | | | RAZVRSTITEV VREDNOSTI IZPOSTAVLJENOSTI GLEDE NA UTEŽI TVEGANJA | | | | | | | | TVEGANJEM PRILAGOJENI ZNESEK IZPOSTAVLJENOSTI | PRILAGODITEV TVEGANJEM PRILAGOJENEGA ZNESKA IZPOSTAVLJENOSTI | SKUPNA KAPITALSKA ZAHTEVA PRED UPORABO CAP | MEMORANDUMSKE POSTAVKE: KAPITALSKE ZAHTEVE, KI USTREZAJO ODLIVOM LISTINJENJA PO SA PRISTOPU V DRUGE RAZREDE IZPOSTAVLJENOSTI | SKUPNA KAPITALSKA ZAHTEVA PO UPORABI CAP |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | (-) STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJA (Cva) | (-) SKUPAJ ODLIVI | VREDNOST ZADRŽANIH ALI REODKUPLJENIH KREDITNIH ZAVAROVANJ | VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI V LISTINJENJU PRED PRED KONVERZIJSKIMI KOLIČINKI | | | OSEBNA KREDITNA ZAVAROVANJA PRILAGOJENE VREDNOSTI (Gia) | STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJA | ZAMENJAVA IZPOSTAVLJENOSTI ZARADI KREDITNIH ZAVAROVANJ | | | | | 0% | >0% IN <=20% | >20% IN <=50% | >50% IN <=100% | | (-) ODBITNE POSTAVKE OD KAPITALA | VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI, KI SE JI DODELI UTEŽ TVEGANJA | OCENJENA IZPOSTAVLJENOST (STOPNJE KREDITNE KAKOVOSTI OD 1 DO 4) | | | | 1250% | | IZPOSTAVLJENOST Z UTEŽMI TVEGANJA IZ SKUPINE OSNOVNE IZPOSTAVLJENOSTI | | | | | | | |
| | | OSEBNA KREDITNA ZAVAROVANJA - PRILAGOJENE VREDNOSTI (G*) | | | | | | | | (-) SKUPAJ ODLIVI | SKUPAJ PRILIVI | | | | | | | | | | 20% | 50% | 100% | 350% | OCENJENA IZPOSTAVLJENOST | NEOCENJENE NA IZPOSTAVLJENOST | | OD KATERIH: TRANŠA Z IZGUBE V ABCP | | | | | |
| | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7=5+6 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 | 18 | 19 | 20 | 21=19+20 | 22 | 23 | 24 | 25 | 26 | 27 | 28 | 29 | 30 | 30 bis | 31 | 32 | 33 |
| **SKUPNA IZPOSTAVLJENOST** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | **Povezava z obrazcem CA** |
| **A. IZVORNA BORZNOPOSREDNIŠKA DRUŽBA: SKUPNA IZPOSTAVLJENOST** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1. POSTAVKE SREDSTEV | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.1. NAJVIŠJA POSTAVKA KREDITNEGA TVEGANJA | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.2. VMESNA POSTAVKA KREDITNEGA TVEGANJA | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.3. POSTAVKA PRVE IZGUBE | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2. ZUNAJBILANČNE POSTAVKE IN IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3. OBNAVLJAJOČE SE IZPOSTAVLJENOSTI Z MOŽNOSTJO PREDČASNEGA ODPLAČILA | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **B. INVESTITOR: SKUPNA IZPOSTAVLJENOST** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1. POSTAVKE SREDSTEV | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.1. NAJVIŠJA POSTAVKA KREDITNEGA TVEGANJA | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.2. VMESNA POSTAVKA KREDITNEGA TVEGANJA | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1.3. POSTAVKA PRVE IZGUBE | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2. ZUNAJBILANČNE POSTAVKE IN IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **C. SPONZOR: SKUPNA IZPOSTAVLJENOST** | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1. POSTAVKE SREDSTEV | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2. ZUNAJBILANČNE POSTAVKE IN IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |