

MKR SA TDI

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

Valuta:

		POZICIJE									
POSAMEZNA POZICIJA		(1)	(2)	(3)	NETO POZICIJA		(-) ZMANJŠANJE ZARADI POZICIJ TRGOVALNE KNJIGE, KI SO VAROVANE S KREDITNIMI IZVEDENIMI FINANČNIMI INSTRUMENTI		POZICIJE, KI SO PREDMET KAPITALSKE ZAHTEVE	UTEŽ (%)	KAPITALSKA ZAHTEVA
DOLGA	KRATKA				DOLGA	KRATKA	DO NETO DOLGE POZICIJE	DO NETO KRATKE POZICIJE			
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)		(9)
DOLŽNIŠKI FINANČNI INSTRUMENTI V TRGOVALNI KNJIGI											
1 Splošno pozicijsko tveganje: pristop, ki temelji na zapadlosti (*)											
1.1 Skupina razredov zapadlosti 1											
0 ≤ 1 meseca (x1)											
> 1 ≤ 3 mesecev (x2)											
> 3 ≤ 6 mesecev (x3)											
> 6 ≤ 12 mesecev (x4)											
1.2 Skupina razredov zapadlosti 2											
> 1 ≤ 2 (1,9 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x5)											
> 2 ≤ 3 (> 1,9 ≤ 2,8 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x6)											
> 3 ≤ 4 (> 2,8 ≤ 3,6 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x7)											
1.3 Skupina razredov zapadlosti 3											
> 4 ≤ 5 (> 3,6 ≤ 4,3 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x8)											
> 5 ≤ 7 (> 4,3 ≤ 5,7 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x9)											
> 7 ≤ 10 (> 5,7 ≤ 7,3 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x10)											
> 10 ≤ 15 (> 7,3 ≤ 9,3 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x11)											
> 15 ≤ 20 (> 9,3 ≤ 10,6 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x12)											
> 20 (> 10,6 ≤ 12,0 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x13)											
> 12,0 ≤ 20,0 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x14)											
> 20 za obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x15)											
1.a Izravnana tehtana pozicija iz vseh skupin razredov zapadlosti (A)										10,00	
1.b Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 1 (B)										40,00	
1.c Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 2 (C)										30,00	
1.d Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 3 (D)										30,00	
1.e1 Izravnana tehtana pozicija med skupinama razredov zapadlosti 1 in 2 (E)										40,00	
1.e2 Izravnana tehtana pozicija med skupinama razredov zapadlosti 2 in 3 (F)										40,00	
1.f Izravnana tehtana pozicija med skupinama razredov zapadlosti 1 in 3 (H)										150,00	
1.g Preostale neizravnane tehtane pozicije (G)										100,00	
2 Splošno pozicijsko tveganje: pristop, ki temelji na trajanju (**)											
2.1 Skupina 1 (0 ≤ 1,0 leta)											
2.2 Skupina 2 (>1,0 do ≤ 3,6 let)											
2.3 Skupina 3 (> 3,6 let)											
2.a Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, iz vseh skupin (A)										2,00	
2.b1 Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 1 in 2 (B)										40,00	
2.b2 Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 2 in 3 (C)										40,00	
2.c Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 1 in 3 (D)										150,00	
2.d Preostale neizravnane pozicije, tehtane s trajanjem (E)										100,00	
3 Posebno pozicijsko tveganje											
3.1 Dolžniški finančni instrumenti prve kategorije										0,00	
3.2 Dolžniški finančni instrumenti druge kategorije											
3.2.a S preostalo zapadlostjo ≤ 6 mesecev										0,25	
3.2.b S preostalo zapadlostjo > 6 mesecev in ≤ 24 mesecev										1,00	
3.2.c S preostalo zapadlostjo > 24 mesecev										1,60	
3.3 Dolžniški finančni instrumenti tretje kategorije										8,00	
3.4 Dolžniški finančni instrumenti četrte kategorije										12,00	
3.5 Listirjene izpostavljenosti, ki so predmet tehtanja z utežjo 1250% ali zmanjšani in likvidnostni aranžmaji brez bonitetne ocene											
4 Pristop za pozicijsko tveganje za pozicije v enotah premoženja CIU											
5 Pristop, ki temelji na kritiju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se trguje na priznanih borzah											
6 Pristop, ki temelji na kritiju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se trguje na prostem trgu (OTC)											
7 Druga ne-delta tveganja (gamma in vega) povezana z opcijami											

(*) Oznake na desni strani se nanašajo na obrazce:MKR SA TDI-a

(**) Oznake na desni strani se nanašajo na obrazce:MKR SA TDI-b