

MKR SA EQU

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

Trg:

	POZICIJE						v tisoč EUR	
	POSAMEZNA POZICIJA		(-) UČINEK ZMANJŠANJA POZICIJE, KI IZHAJA IZ PRVE PRODAJE LASTNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTOV Z OBVEZNOSTJO ODKUPA	NETO POZICIJA		POZICIJE, KI SO PREDMET KAPITALSKE ZAHTEVE	UTEŽ (%)	KAPITALSKA ZAHTEVA
	DOLGA	KRATKA		DOLGA	KRATKA			
	(1)	(2)		(4)	(5)	(6)		(7)
LASTNIŠKI FINANČNI INSTRUMENTI V TRGOVALNI KNJIGI								Povezava z obrazcem CA
1 Splošno pozicijsko tveganje							8,00	
1.1 Terminske pogodbe na delniške indekse, ki so predmet posebne obravnave								
1.2 Drugi lastniški finančni instrumenti, razen terminskih pogodb na delniške indekse								
2 Posebno pozicijsko tveganje								
2.1 Visoko kvalitetni, likvidni in široko razpršeni portfelji, ki so predmet nižjih kapitalskih zahtev							2,00	
2.2 Drugi lastniški finančni instrumenti (razen visoko kvalitetnih, likvidnih in široko razpršenih portfeljev)							4,00	
3 Pristop za pozicijsko tveganje za pozicije v enotah premoženja CIU								
4 Pristop, ki temelji na kritju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se trguje na priznanih borzah								
5 Pristop, ki temelji na kritju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se trguje na prostem trgu (OTC)								
6 Druga ne-delata tveganja (gama in vega) za opcije								