

MKR SA TDI - a

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

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

Valuta:

v tisoč EUR

Skupina	Razred	Posamezna neto pozicija (iz MKR SA TDI, vrstice od 1.1 do 1.3)		Utež (v %)	Tehtana neto pozicija		Po razredih		Po skupinah		Med skupinami	
					Dolga	Kratka	Izravnano	Neizravnano	Izravnano	Neizravnano	Izravnano	
		Dolga	Kratka									
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
1	x1			0,00%							Sk. 1 in 2	Sk. 1 in 3 H
1	x2			0,20%					B			
1	x3			0,40%								
1	x4			0,70%								
2	x5			1,25%							E	Sk. 2 in 3 F
2	x6			1,75%					C			
2	x7			2,25%								
3	x8			2,75%							Sk. 2 in 3 F	
3	x9			3,25%								
3	x10			3,75%								
3	x11			4,50%					D			
3	x12			5,25%								
3	x13			6,00%								
3	x14			8,00%								
3	x15			12,50%								

Skupaj

A

G

Skupna kapitalska zahteva = 10% A + 40% B + 30% (C+D) + 40% (E+F) + 100% G + 150% H = _____

Tabela se izpolni za vsako valuto posebej.