

CR SA

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA KREDITNO TVEGANJE, KREDITNO TVEGANJE NASPROTNE STRANKE IN TVEGANJE ZARADI ČASOVNE NEUSKLAJENOSTI PLAČILA IN IZROČITVE PO STANDARDIZIRANEM PRISTOPU

SA / IRB kategorija izpostavljenosti:

Imenovane ECAI in/ali ECA:

v tisoč EUR																						
	ORIGINALNA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI PRED UPORABO KONVERZUSKIH FAKTORJEV	OD TEGA: IZ NASLOVA KREDITNEGA TVEGANJA NASPROTNE STRANKE (CCR)	OSLABITVE IN REZERVACIJE POVEZANE Z ORIGINALNO IZPOSTAVLJE- NOSTJO	NETO VREDNOST IZPOSTAVLJE- NOSTI	KREDITNA ZAVAROVANJA Z UČINKOM ZAMENJAVE NA IZPOSTAVLJENOST						NETO IZPOSTAVLJE- NOST PO UPOŠTEVANJU ORNI IN PRED UPORABO KONVERZUSKIH 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 KONVERZUSKE FAKTORJE				VREDNOST IZPOSTAVLJE- NOSTI	TVEGANJEM PRILAGOJEN ZNESEK IZPOSTAVLJE- NOSTI	KAPITALSKA ZAHTEVA	
					USKOROK KREDITNA ZAVAROVANJA; PRILAGOJENE VREDNOSTI (1)		STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJA		ZAMENJAVA IZPOSTAVLJENOSTI ZARADI KREDITNEGA ZAVAROVANJA			VREDNOST PRILAGODITV E ZA NESTANOVIT- NOST IZPOSTAV- LJENOSTI	ZAVAROVANJE S FINANČNIM PREMOŽENJEM:		0%	20%	50%	100%				
					OSEBNA JAMSTVA	KREDITNI IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI	FINANČNO PREMOŽENJE ENOSTAVNA METODA	DRUGA STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJ A	CELOTNI ODLIVI	CELOTNI PRILIVI			PRILAGOJENA VREDNOST (Cvram)									PRILAGODITV E ZA NESTANOVIT- NOST IN ZAPADLOST
	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=21*8%
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)																						
brez bonitetne ocene imenovane ECAI																						
200%																						
Druge uteži tveganja																						

(a) Izpolni borznoposredniška družba, ki ima dovoljenje Agencije za uporabo pristopa IRB.