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 LISTINJENE IZPOSTAVLJENOSTI			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 KOLIČNIKOV	(-) KREDITNA ZAVAROVANJA, KI UČINKUJEJO NA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI, RAZVITA METODA ZA ZAVAROVANJE S FINANČNIMI PREMOŽENJEM (Cvam)	POLNO PRILAGOJENA VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI (E*)	RAZVRSTITEV POLNO PRILAGOJENIH VREDNOSTI ZUNAJBILANČNIH POSTAVK (E*) GLEDE NA KONVERZIJSKE KOLIČNIKE				VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI	(-) ODBITNE POSTAVKE OD KAPITALA	VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI, KI SE JI DODELI UTEŽ TVEGANJA	RAZVRSTITEV VREDNOSTI IZPOSTAVLJENOSTI GLEDE NA UTEŽI TVEGANJA								TVEGANJEM PRILAGOJEN ZNESEK IZPOSTAVLJENOSTI	PRILAGODITEV ZARADI NEUSTREZNE SARBINOSTI	PRILAGODITEV TVEGANJEM PRILAGOJENEGA ZNESKA IZPOSTAVLJENOSTI ZA NEUSKLAJENOST ZAPADLOSTI	SKUPNA KAPITALSKA ZAHTEVA PRED UPORABO CAP	MEMORANDUMSKE POSTAVKE: KAPITALSKE ZAHTEVE, KI USTREZAJO ODLOMOM LISTINJENJA PO SA PRISTOPU V DRUGE RAZREDE IZPOSTAVLJENOSTI	SKUPNA KAPITALSKA ZAHTEVA PO UPORABI CAP
		(-) STVARNA KREDITNA ZAVAROVANJA (Cva)	(-) SKUPAJ ODLIVI	VREDNOST ZADRŽANIH ALI RECOKUPLJENIH KREDITNIH ZAVAROVANJ	VREDNOST IZPOSTAVLJENOSTI V LISTINJENJU PRED PRED KONVERZIJSKIMI KOLIČNIKI			OSEBNA KREDITNA ZAVAROVALNA-PRILAGOJENE VREDNOSTI (Gs)	STVARNA KREDITNA ZAVAROVALNA	ZAMENJAVA IZPOSTAVLJENOSTI ZARADI KREDITNIH ZAVAROVANJ						0%	>0% IN <=20%	>20% IN <=50%	>50% IN <=100%				20%	50%	100%	350%							
			OSEBNA KREDITNA ZAVAROVALNA-PRILAGOJENE VREDNOSTI (Gs*)							(-) SKUPAJ ODLIVI	SKUPAJ PRILIVI															OCENJENA IZPOSTAVLJENOST (STOPNJE KREDITNE KAKOVOSTI OD 1 DO 4)				1250%		IZPOSTAVLJENOST Z UTEŽNE TVEGANJA IZ SKUPNE OSNOVNE IZPOSTAVLJENOSTI						
																												OCENJENA IZPOSTAVLJENOST	NEOCENJENA 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	30 bis	31	32	33
SKUPNA IZPOSTAVLJENOST																																		Povezava z obrazcem CA
A. ORIGINATOR: 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																																		
od tega: pozicije v listinjenjih, pri katerih originator in sponzor nista kreditna institucija ali investicijsko podjetje																																		
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																																		