

MKR SA TDI

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

Valuta:

v 1000 EUR

			POZICIJE							
POSAMEZNA POZICIJA		(-) UČINEK ZMANJŠANJA POZICIJE, KI IZHAJA IZ PRVE PRODAJE DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTOV Z OBVEZNOSTJO ODKUPA	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 manjš 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 obresno 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 obresno mero manjšo od 3%) let	(x15)									
1.a Izravnana tehtana pozicija iz vseh skupin razredov zapadlosti	(A)									
1.b Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 1	(B)							10,00		
1.c Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 2	(C)							40,00		
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)							30,00		
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)							40,00		
1.g Preostale neizravnane tehtane pozicije	(G)							150,00		
								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.b1 Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 1 in 2	(B)							2,00		
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)							40,00		
2.d Preostale neizravnane pozicije, tehtane s trajanjem	(E)							150,00		
								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 inš 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		
4 Pristop za pozicijsko tveganje za pozicije v enotah premoženja CIU										
5 Pristop, ki temelji na kritju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se trguje na priznanih borzah										
6 Pristop, ki temelji na kritju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se trguje na prostem trgu (OTC)										
7 Druga ne-delta tveganja (gama in vega) povezana z opcijami										

(*) Oznake na desni strani se nanašajo na obrazecMKR SA TDI-a

(**) Oznake na desni strani se nanašajo na obrazecMKR SA TDI-b