

	VaR		VaR izjemnih situacij (SVaR)		KAPITALSKA ZAHTEVA ZA PRESEŽNO TVEGANJE NEPLAČILA IN MIGRACIJE		KAPITALSKA ZAHTEVA ZA CENOVNA TVEGANJA V TRGOVALNEM PORTELU S KORELACIJO				KAPITALSKA ZAHTEVA	Memorandumske postavke:				
	MULTIPLIKACIJSKI FAKTOR (m _L) x POVPREČJE ZA VA R ZA PRETEKLJH 60 DELOVNIH DNI (VaR _{m,d})	VaR PREJŠNJUEGA DNE (VaR _{L,t})	MULTIPLIKACIJSKI FAKTOR (m _L) x POVPREČJE ZA SVaR ZA PRETEKLJH 60 DELOVNIH DNI (SVaR _{m,d})	ZADNJI RAZPOLOŽLJIVI SVaR (SVaR _{L,t})	POVPREČNA VREDNOST 12-ih TEDNOV	ZADNJA VREDNOST	MINIMALNA KAPITALSKA ZAHTEVA	POVPREČNA VREDNOST 12-ih TEDNOV	ZADNJA VREDNOST	DODATNA KAPITALSKA ZAHTEVA ZA IZJEMNE SITUACIJE		Število preseganj v zadnjih 250 delovnih dnevih	Multiplikacijski faktor (m _L)	Multiplikacijski faktor (m _L)	TEHTANA NETO DOLGA POZICIJA ZA TRGOVALNI PORTELU S KORELACIJO PO UPORABI CAP (STANDARDIZIRAN PRISTOP)	TEHTANA NETO KRATKA POZICIJA ZA TRGOVALNI PORTELU S KORELACIJO PO UPORABI CAP (STANDARDIZIRAN PRISTOP)
(1)	(2)	(3a)	(3b)	(4a)	(4b)	(4c) = 8% * max{(8), (9)}	(4d)	(4e)	(4f)	(5) = Max{(1),(2)} + Max{(3a),(3b)} + Max {(4a),(4b)} + Max {(4c), (4d),(4e)} - (4f)	(6)	(7a)	(7b)	(8)	(9)	
SKUPNE POZICIJE										Povečava z obracem CA						
Memorandum postavk: razstavljanje vsakega posameznega tržnega tveganja																
1 Dolžniški finančni instrumenti																
1.1 Splošno tveganje																
1.2 Posebno tveganje																
2 Lastniški finančni instrumenti																
2.1 Splošno tveganje																
2.2 Posebno tveganje																
3 Valutno tveganje																
4 Tveganje spremembe cen blaga																
5 Skupna vrednost splošnega tveganja																
6 Skupna vrednost posebnega tveganja																