

MKR SA CTP

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA POSEBNO POZICIJSKO TVEGANJE ZA TRGOVALNI PORTFELJ S KORELACIJO PO STANDARDIZIRANEM PRISTOPU

☐ Y Štaci EUR	☐ Y Štaci EUR
--	--

	SKUPAJ POZICIJE		(-) ODBITNE POSTAVKE OD KAPITALA		NETO POZICIJE		RAZVRSTITEV NETO DOLGH POZICIJ GLEDE NA SA IN IRB UTEŽI TVEGANJA														RAZVRSTITEV NETO KRAHKIH POZICIJ GLEDE NA SA IN IRB UTEŽI TVEGANJA														PRED UPORABO CAP		PO UPORABI CAP		SKUPNA KAPITALSKA ZAHTEVA					
							UTEŽ TVEGANJA < 1250%										1250%				METODA NAZDORNIŠKE FORMALNE	POZICIJA Z UTEŽNI TVEGANJA IZ SKUPNE ODKOVNE IZPOSTAVLJENOSTI	METODA NOTRANJEGA OCENJEVANJA		OSTALO	UTEŽ TVEGANJA < 1250%								1250%						METODA NAZDORNIŠKE FORMALNE	POZICIJA Z UTEŽNI TVEGANJA IZ SKUPNE ODKOVNE IZPOSTAVLJENOSTI	METODA NOTRANJEGA OCENJEVANJA		OSTALO
	DOLGA	KRATKA	DOLGA	KRATKA	DOLGA	KRATKA	7 - 10%	11 - 20%	20 - 25%	40 - 75%	100%	250%	350%	425%	650%	OCENJENA POZICIJA	NEOCENJENA POZICIJA	POVPREČNA UTEŽ TVEGANJA (%)	POZICIJA Z UTEŽNI TVEGANJA IZ SKUPNE ODKOVNE IZPOSTAVLJENOSTI	POVPREČNA UTEŽ TVEGANJA (%)			OSTALO	7 - 10%		11 - 20%	20 - 30%	40 - 75%	100%	250%	350%	425%	650%	OCENJENA POZICIJA	NEOCENJENA POZICIJA	POVPREČNA UTEŽ TVEGANJA (%)	POZICIJA Z UTEŽNI TVEGANJA IZ SKUPNE ODKOVNE IZPOSTAVLJENOSTI	POVPREČNA UTEŽ TVEGANJA (%)				OSTALO	TEHTANA NETO DOLGA POZICIJA	
																					1	2			3															4	5			6
SKUPNA IZPOSTAVLJENOST																																												
ORIGINATOR: SKUPNA IZPOSTAVLJENOST																																												
POZICIJE V LISTINJENJU																																												
KREDITNI IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI NA PODLAGI N-TEGA NEPLAČILA																																												
OSTALE POZICIJE V TRGOVALNEM PORTEFELJU S KORELACIJO																																												
INVESTITOR: SKUPNA IZPOSTAVLJENOST																																												
POZICIJE V LISTINJENJU																																												
KREDITNI IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI NA PODLAGI N-TEGA NEPLAČILA																																												
OSTALE POZICIJE V TRGOVALNEM PORTEFELJU S KORELACIJO																																												
SPONZOR: SKUPNA IZPOSTAVLJENOST																																												
POZICIJE V LISTINJENJU																																												
KREDITNI IZVEDENI FINANČNI INSTRUMENTI NA PODLAGI N-TEGA NEPLAČILA																																												
OSTALE POZICIJE V TRGOVALNEM PORTEFELJU S KORELACIJO																																												
Povezava z izrazom CA																																												