

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

Valuta

v tisoč EUR

	POSAMEZNA POZICIJA		(-) UČINEK ZMANJŠANJA POZICIJE, KI IZHAJA IZ PRVE PRODAJE DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTOV Z OBVEZNOSTJO ODKUPA	NETO POZICIJA		(1) 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										Povečava z obrazcem CA
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, manjšo 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 obrestno 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 obrestno mero, manjšo od 3 %) let (x15)										
1.a Izravnana tehtana pozicija iz vseh skupin razredov zapadlosti (A)									10,00	
1.b Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 1 (B)									40,00	
1.c Izravnana tehtana pozicija iz skupine razredov zapadlosti 2 (C)									30,00	
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)									40,00	
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)									150,00	
1.g Preostale neizravnane tehtane pozicije (G)									100,00	
2 Splošno pozicijsko tveganje: pristop, ki temelji na trajanju (**) (0 ≤ 1,0 leta)										
2.1 Skupina 1 (>1,0 do ≤ 3,6 let)										
2.2 Skupina 2 (> 3,6 let)										
2.3 Skupina 3 (A)									2,00	
2.a Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, iz vseh skupin (B)									40,00	
2.b1 Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 1 in 2 (C)									40,00	
2.b2 Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 2 in 3 (D)									150,00	
2.c Izravnana pozicija, tehtana s trajanjem, med skupinama 1 in 3 (E)									100,00	
2.d Preostale neizravnane pozicije, tehtane s trajanjem										
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 in ≤ 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 CJU										
5 Pristop, ki temelji na kritiju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se igraje na prizvanih borzah										
6 Pristop, ki temelji na kritiju za terminske pogodbe in opcije, s katerimi se igraje na prostem trgu (OTC)										
7 Druga re-delta tveganja (gamma in vega) povezana z opcijami										

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

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