MKR IM

IZRAČUN KAPITALSKE ZAHTEVE ZA POZICIJSKO TVEGANJE, VALUTNO TVEGANJE IN/ALI TVEGANJE SPREMEMB CEN BLAGA Z UPORABO NOTRANJIH MODELOV

v tisoč EUR

	VaR		VaR izjemnih situacij (SVaR)		Kapitalska zahteva za presežno tveganje neplačila in migracije		Kapitalska zahteva za cenovna tveganja v trgovalnem portfelju s korelacijo				Kapitalska zahteva	Memurandumske postavke:				
	Multiplikacijski faktor (m_c) x Povprečje za VaR za pretekli 60 delovnih dni (VaR_{avg})	VaR prejšnjega dne (VaR_{t-1})	Multiplikacijski faktor (m_s) x Povprečje za SVaR za pretekli 60 delovnih dni ($SVaR_{avg}$)	Zadnji razpoložljivi SVaR ($SVaR_{t-1}$)	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 dneh	Multiplikacijski faktor (m_c)	Multiplikacijski faktor (m_s)	Tehtana neto dolga pozicija za trgovalni portfelj s korelacijo po uporabi CAP (standardizirani pristop)	Tehtana neto kratka pozicija za trgovalni portfelj s korelacijo po uporabi CAP (standardizirani pristop)
	1	2	3a	3b	4a	4b	4c=8%*Max [(8),(9)]	4d	4e	4f	5	6	7a	7b	8	9
SKUPNE POZICIJE											Povezava z obrazcem 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																