

**ИЗВЕШТАЈ**

за капиталот потребен за покривање на генералниот ризик од вложувања во должнички инструменти

| Зона | Групи на преостаната рочност |                               |                        | Позиција |        | Пондер (во %) | Пондерирана позиција |        |
|------|------------------------------|-------------------------------|------------------------|----------|--------|---------------|----------------------|--------|
|      | Група                        | Каматна стапка од 3% и повеќе | Каматна стапка до 3%   | Долга    | Кратка |               | Долга                | Кратка |
| 1    | 2                            | 3                             | 4                      | 5        | 6      | 7             | 8=5x7                | 9=6x7  |
| I    | 1                            | 0 - 1 месец (1)               | 0 - 1 месец (1)        |          |        | 0             |                      |        |
|      |                              | Инструмент 1                  |                        |          |        | 0             |                      |        |
|      |                              | Инструмент 2                  |                        |          |        | 0             |                      |        |
|      |                              |                               | Инструмент 3           |          |        | 0             |                      |        |
|      |                              | ...                           | ...                    |          |        | 0             |                      |        |
| I    | 2                            | 1 - 3 месеци (2)              | 1 - 3 месеци (2)       |          |        | 0.2           |                      |        |
| I    | 3                            | 3 - 6 месеци (3)              | 3 - 6 месеци (3)       |          |        | 0.4           |                      |        |
| I    | 4                            | 6 - 12 месеци (4)             | 6 - 12 месеци (4)      |          |        | 0.7           |                      |        |
| II   | 5                            | 1 - 2 години (5)              | 1.0 - 1.9 години (5)   |          |        | 1.25          |                      |        |
| II   | 6                            | 2 - 3 години (6)              | 1.9 - 2.8 години (6)   |          |        | 1.75          |                      |        |
| II   | 7                            | 3 - 4 години (7)              | 2.8 - 3.6 години (7)   |          |        | 2.25          |                      |        |
| III  | 8                            | 4 - 5 години (8)              | 3.6 - 4.3 години (8)   |          |        | 2.75          |                      |        |
| III  | 9                            | 5 - 7 години (9)              | 4.3 - 5.7 години (9)   |          |        | 3.25          |                      |        |
| III  | 10                           | 7 - 10 години (10)            | 5.7 - 7.3 години (10)  |          |        | 3.75          |                      |        |
| III  | 11                           | 10 - 15 години (11)           | 7.3 - 9.3 години (11)  |          |        | 4.5           |                      |        |
| III  | 12                           | 15 - 20 години (13)           | 9.3 - 10.6 години (12) |          |        | 5.25          |                      |        |
| III  | 13                           | над 20 години (14)            | 10.6 - 12 години (13)  |          |        | 6             |                      |        |
| III  | 14                           |                               | 12 - 20 години (14)    |          |        | 8             |                      |        |
| III  | 15                           |                               | над 20 години (15)     |          |        | 12.5          |                      |        |