

ИЗВЕШТАЈ

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

Зона	Група	Пондирани позиции (колони 8 и 9)		Усогласена пондерирана позиција за група	Неусогласена пондерирана позиција за група		Хоризонтално усогласување во зона	Неусогласена пондерирана позиција во зона	Хоризонтално усогласување помеѓу зоните	
		Долга	Кратка		Долга	Кратка				
1	2	3	4	5	6=3-4	7=4-3	8	9=6-7	10	11
	1									
	2									
	3									
	4									
I				AI = 1+2+3+4	0	0	BI	CI		
	5									
	6								D= помало од CI или CII	
	7									
II				AII= 5+6+7	0	0	BII	CII		
	8									
	9									F= помало од остаток од D или CIII (ако CI>CII)
	10									
	11								E= помало од остаток од D или CIII (ако CII>CI)	
	12									
	13									
	14									
	15									
III				AIII=8+9+10+11+12 +13+14+15	0	0	BIII	CIII		
Вкупно				A=AI+AII+AIII				C=CI+CII+CIII		
IV	Капитал потребен за покривање на генералниот ризик од вложувања во должнички инструменти = 10% A + 40% BI+30% (BII+BIII)+40% (D+E)+150% F+100% C									0

Затемнетите полиња не се пополнуваат.