

EK 2.

BANKA ADI:

GENEL PİYASA RİSKİ HESAPLAMASINA YÖNELİK- FAİZ ORANI RİSKİ ANALİZİ - VADE MERDİVENİ (Standart Metod)

PARA BİRİMİ: BİN TRL

PARA KODU:

DÖNEM: _/_/_

Vade dilimleri	Zaman Aralığı-I				Zaman Aralığı-II			Zaman Aralığı-III					
	1 AY	1-3 AY	3-6 AY	6-12 AY	1-2 YIL	2-3 YIL	3-4 YIL	4-5 YIL	5-7 YIL	7-10 YIL	10-15 YIL	15-20 YIL	20+ YIL
Uzun Pozisyonlar													
1 MDC (Borçl.Tem.Eden Men.Kıy.)													
2 Repo Konusu Menkul Değerler													
3 Swap Faiz Alım İşlemleri													
4 Swap Para Alım İşlemleri													
5 Vadeli Döviz Alım İşlemleri													
6 Futures Para Alım İşlemleri													
7 Futures Faiz Alım İşlemleri													
8													
9													
10													
11													
12													
13													
14													
15													
16													
Kısa Pozisyonlar													
17 Repo İşlemlerinden Sağ. Fonlar													
18 Swap Faiz Satım İşlemleri													
19 Swap Para Satım İşlemleri													
20 Vadeli Döviz Satım İşlemleri													
21 Futures Para Satım İşlemleri													
22 Futures Faiz Satım İşlemleri													
23													
24													
25													
26													
27													
28													
29													
30													
31 Risk Ağırlıkları	0,0000	0,0020	0,0040	0,0070	0,0125	0,0175	0,0225	0,0275	0,0325	0,0375	0,0450	0,0525	0,0600
Risk Ağırlıklı Pozisyonlar													
32 Uzun Pozisyonlar Toplamı													
33 Kısa Pozisyonlar Toplamı													
34 Dikey Sermaye Gereksinimi													
35 Vade Dilimleri Net Pozisyon													
36 Uzun Pozisyon													
37 Kısa Pozisyon													
38 YSG-I													
39 Net Kalan Pozisyon													
40 YSG-II													
41 Net Kalan Pozisyon													
42 YSG-III													
43 Sermaye Gereksinimleri													
44 TOPLAM													