

Bližší vymezení korekčního faktoru pro výpočet kapitálového požadavku k riziku angažovanosti obchodního portfolia

1. Výše korekčního faktoru je závislá na četnosti převýšení součtu dlouhých a krátkých pozic obchodního portfolia vůči osobě podle bodu 2 nad zbytkovou angažovaností vůči osobě během 9 pracovních dnů předcházejících dni vykazování a na velikosti převýšení v den vykazování.
2. Korekční faktor ve sloupci A tabulky v této příloze se použije, pokud došlo k tomuto převýšení ve všech deseti pracovních dnech.
3. Korekční faktor ve sloupci B tabulky v této příloze se použije, pokud převýšení trvalo méně než 10 pracovních dnů.

Tabulka

Převýšení v den vykazování	Korekční faktor	
	A	B
do 40 % včetně kapitálu	2	2
od 40 do 60 % včetně kapitálu	3	2
od 60 do 80 % včetně kapitálu	4	2
od 80 do 100 % včetně kapitálu	5	2
od 100 do 250 % včetně kapitálu	6	2
nad 250 % kapitálu	9	2