

Приложение

к Методике определения
риск-параметров
финансовых
инструментов

Таблица фундаментальных риск-параметров биржевых рынков

№	Параметр	Вид биржевого рынка, для расчета риск-параметров финансовых инструментов которого, такой параметр используется							
		Обозначение	Рынок деривативов			Фондовый рынок	Валютный рынок		
			Базовый актив - Акции	Базовый актив - Индекс KASE	Базовый актив – Курсы иностранных валют				
1	Уровень доверия/квантиль	$-\alpha$	99.87 %						
2	Исторический период	–	1 год						
3	Горизонт оценки рисков	T_{RH}	2 торговых дня	2 торговых дня	2 торговых дня	2 торговых дня	2 торговых дня	2 торговых дня	
		T_{Liqu}	5 торговых дней	5 торговых дней	5 торговых дней	5 торговых дней	5 торговых дней	5 торговых дней (при расчете ставок концентрации)	
4	Коэффициент концентрации	K_{conc}	100 %	100 %	USD 30 % EUR 50 %	RUB 50 % CNY 50 %	100 %	USD 30 % EUR 50 %	RUB 50 % CNY 50 %
5	Коэффициент лимита изменения цены	K_{Price}	–				1	–	
6	Верхняя граница коэффициента взвешивания	$a_{верхнее}$	–				0,06		
7	Нижняя граница коэффициента взвешивания	$a_{нижнее}$	–				0,03		
8	Процентная надбавка	$CONST_{kzt}$	–				6%	–	
		$CONST_{USD}$	–				2%	2%	
		$CONST_{EUR}$	–				2%	2%	
		$CONST_{RUB}$	–				2%	2%	
		$CONST_{CNY}$	–				2%	2%	