

Қаржы құралдарының тәуекел-параметрлерін анықтау әдістемесіне

қосымша

Биржалық нарықтардың іргелі тәуекел-параметрлерінің кестесі

№	Параметр	Қаржы құралдарының тәуекел-параметрлерін есептеу үшін осындай параметр пайдаланылатын биржалық нарықтың түрі								
		Белгісі	Рынок деривативов				Қор нарығы	Валюталық нарық		
			Базалық актив – Акциялар	Базалық актив – KASE Индексі	Базалық актив – Шетел валюталарының бағамдары					
1	Сенім деңгейі/квантиль	$-\alpha$	99.87 %							
2	Тарихи кезең	–	1 год							
3	Тәуекелдерді бағалау шегі	T_{RH}	2 сауда-саттық күн	2 сауда-саттық күн	2 сауда-саттық күн		2 сауда-саттық күн	2 сауда-саттық күн		
		T_{Liqv}	5 сауда-саттық күн	5 сауда-саттық күн	5 сауда-саттық күн		5 сауда-саттық күн	5 сауда-саттық күн (шоғырлану мөлшерлемелерін есептеу кезінде)		
4	Шоғырлану коэффициенті	K_{conc}	100 %	100 %	USD 30 % EUR 50 %	RUB 50 % CNY 50 %	100 %	USD 30 % EUR 50 %	RUB 50 % CNY 50 %	
5	Баға өзгеруі шектелімінің коэффициенті	K_{Price}	–				1	–		
6	Саралау коэффициентінің жоғарғы шегі	$a_{верхнее}$	–				0,06			
7	Саралау коэффициентінің төменгі шегі	$a_{нижнее}$	–				0,03			
8	Пайыздық үстеме	$CONST_{KZT}$	–				6%	–		
		$CONST_{USD}$	–				2%	2%		
		$CONST_{EUR}$	–				2%	2%		
		$CONST_{RUB}$	–				2%	2%		
		$CONST_{CNY}$	–				2%	2%		