

ТАБЛИЦА
фундаментальных параметров биржевых рынков

№	Параметр	Вид биржевого рынка, для расчета риск-параметров финансовых инструментов которого, такой параметр используется				
		Обозначение	Рынок деривативов	Фондовый рынок	Валютный рынок	
1.	Уровень доверия	–	99,87 %			
2.	Исторический период	–	1 год			
3.	Горизонт оценки рисков	T_{RH}	3 торговых дня	3 торговых дня	2 торговых дня	
		T_{Liqu}	–	15 торговых дней (при расчете ставок концентрации)	5 торговых дней (при расчете ставок концентрации)	
4.	Коэффициент концентрации	K_{conc}	–	100 %	USD 30 % EUR 50 %	RUB 50 % CNY 50 %
5.	Коэффициент лимита изменения цены	K_{price}	1		–	

№	Параметр	Вид биржевого рынка, для расчета риск-параметров финансовых инструментов которого, такой параметр используется			
		Обозначение	Рынок деривативов	Фондовый рынок	Валютный рынок
6.	Ставки урегулирования дефолта	SD _{USDNB}	–	–	$SD_{USDNB} = (R_{KZT}^* - R_{USD}^{**}) / (1 + R_{USD})$ <p>* R_{KZT} = базовая ставка Национального Банка – 1 % ** R_{USD} = однодневная ставка LIBOR по долларам США за предыдущий рабочий день по данным Bloomberg или Thomson Reuters</p>
		SD _{USD}	–	–	SD _{USD} = LIBOR
		SD _{KZT}	–	–	SD _{KZT} = базовая ставка Национального Банка + 2 %
		SD _{EUR}	–	–	SD _{EUR} = 0 %
		SD _{RUB}	–	–	SD _{RUB} = MOSPRIME
		SD _{CNY}	–	–	SD _{CNY} = HIBOR