

MKR IM Details

TRŽNO TVEGANJE: NOTRANJI MODEL

OSNOVNI PODATKI					
REGULATORNI VaR				NOTRANJI VaR	
KODA INSTRUMENTA ZA REGULATORNI NOTRANJI MODEL	KODA IZRAČUNA POSEBNEGA TVEGANJA LASTNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTOV	KODA IZRAČUNA POSEBNEGA TVEGANJA DOLŽNIŠKIH FINANČNIH INSTRUMENTOV	UPORABLJENA KODA ZA SPREMEMBO VREDNOSTI PORTFELJA ZA IZRAČUN ŠTEVILA PRESEGANJ	ENOSTRANSKI INTERVAL ZAUPANJA NOTRANJEGA VaR (a)	OBDOBJE POSEDOVANJA NOTRANJEGA VaR (b)
1	2	3	4	5	6

Dan	REGULATORNI VaR					NOTRANJJI VaR (c)	LIMIT NOTRANJEGA VaR	DEJANSKO UPORABLJENA SPREMEMBA VREDNOSTI PORTFELJA ZA TESTIRANJE ZA NAZAJ	
	INTERVAL ZAUPANJA = 99%			KAPITALSKA ZAHTEVA ZA PRESEŽNO TVEGANJE NEPLAČILA IN MIGRACIJE	KAPITALSKA ZAHTEVA ZA CENOVNA TVEGANJA V TRGOVALNEM PORTFELJU S KORELACIJO (z izključitvijo dodatne kapitalске zahteve za izjemne situacije)			Hipotetična	Dejanska
	VaR (T=10)	VaR (T=1)	SVaR (T=10)						
7	8	9	9b	11a	11b	12	13	14	15
1									
2									
3									
4									
5									
6									
7									
8									
9									
10									
...									
...									
91									
92									

- (a) Se izpolnjuje v primeru, ko izračun notranjega VaR temelji na intervalu zaupanja, ki je različen od 99%
- (b) Se izpolnjuje v primeru, ko izračun notranjega VaR temelji na investicijskem obdobju 10 dni
- (c) Se izpolnjuje v primeru, ko je izračun notranjega VaR različen od stolpca 8 ali 9