

РЕЗУЛЬТАТЫ РАСЧЕТОВ

Влияние на нормативы

Валютный своп	Биржевая сделка с ЦК	Внебиржевая с ЦК (4)	Внебиржевая без ЦК с контрагентом рейтинг Ва(6)	Формула
ИТОГО влияние на Н1(3)	512 000р.	1 753 500р.	28 503 363р.	$KPC+KP+PP+PCK$
ИТОГО влияние на Н6	0р.	1 241 500р.	24 830 000р.	KPC

РАСЧЕТЫ

Пример расчета кредитного риска

Валютный своп	Биржевая сделка с ЦК	Внебиржевая сделка с ЦК (5)	Внебиржевая сделка с контрагентом рейтинг Ва(6)	Формула
Текущий кредитный риск (ТКР)	не рассчитывается	23 830 000р.	23 830 000р.	Номинал (таб.1) * Волатильность инструмента (таб.2)
Потенциальный кредитный риск (ПКР)		1 000 000р.	1 000 000р.	Номинал*коэффициент взвешивания потенциального риска по срочным сделкам) (таб.3)
Кредитный риск по срочным сделкам (КРС)		1 241 500р.	24 830 000р.	(ТКР+ПКР)*коэффициент взвешивания в зависимости от сделки (таб.3)
Кредитный риск на ГО(4) (КР)	432 000р.	432 000р.	не рассчитывается (7)	Номинал (таб.1)*Величина ГО (таб.2)*коэффициент взвешивания в зависимости от сделки (таб.3)

Пример расчета рыночного риска

Закрытая позиция	200 000р.	200 000р.	200 000р.	Номинал (таб.1)*Временной интервал 1-3 месяца (таб.4)
Открытая позиция для ОПР (1-3 месяца)	0р.	0р.	0р.	Номинал (таб.1)*Временной интервал 1-3 месяца (таб.4)- закрытая позиция
Закрытая взвешенная позиция зона 1 (для ОПР)	80 000р.	80 000р.	80 000р.	Закрытая позиция*закрытая взвешенная позиция зона 1 (таб.4)
Рыночный риск (РР)	80 000р.	80 000р.	80 000р.	Открытая позиция для ОПР + закрытая взвешенная позиция зона 1

ПАРАМЕТРЫ ДЛЯ РАСЧЕТА

Параметры модельной сделки (Таблица 1)

Параметры	Валютный своп
Номинал	100 000 000р.
Срок сделки	3 месяца

Параметры для расчета КРС и КР (Таблица 2)

Волатильность инструмента (1) (устанавливает участник)	23,83%
Величина ГО (устанавливает НКЦ)	8,64%

Инструкция Банка России от 03.12.2012 N 139-И (Таблица 3)

	Коэффициент взвешивания
Потенциальный риск по срочным сделкам	0,01
Внебиржевая сделка с ЦК(2)	5%
Внебиржевая сделка с контрагентом рейтинг Ва	100%

Положение Банка России N 511-П от 03.12.2015 (Таблица 4)

	Коэффициент взвешивания
Временной интервал 1-3 месяца (зона 1)	0,2%
Закрытая взвешенная позиция зона 1	40,0%

Пример расчета риска потери кредитоспособности контрагента

Дисконт (D_j)	не рассчитывается	не рассчитывается	0,994	$D_j = \frac{1 - \exp(-0,05 \times M_j)}{0,05 \times M_j}$
A_i			123 377	$A_i = w_i \times \left(\sum_j M_j \times KPC \times D_j \right)$
РСК			3 593 363,44р.	$\sqrt{\left(0,5 \times \sum_j A_j - \sum_j A_j w_j \right)^2 + 0,75 \times \sum_j (A_j)^2}$

1. Максимальная переоценка стоимости инструмента в процентах от номинала

2. В соответствии с информацией опубликованной <http://www.cbr.ru/credit/cicc.asp>
http://www.cbr.ru/pw.aspx?file=/press/if/131023_171237intern3.htm

3. Расчеты производятся для одной сделки

4. Без учета коэффициента на ККО, т.к. приведен пример лишь одной из многих сделок

5. Размер КРС может быть снижен при заключении нескольких разнонаправленных сделок, включенных в соглашение о неттинге. Расчет снижения КРС не производился, т.к. приведен пример лишь одной из многих сделок.

6. Рейтинг долгосрочной кредитоспособности Moody's Investors Service

7. Предполагаем, что при заключении сделок на внебиржевом рынке участники не заносят гарантийное обеспечение.

Инструкция Банка России от 03.12.2012 N 139-И (Таблица 5)

	Значение коэффициента
Рейтинг долгосрочной кредитоспособности Ва () w_j	2
Оставшийся срок в годах (M_j)	0,25