

## Раздел VII. Рыночный риск

В настоящем разделе кредитная организация раскрывает информацию о расчете требований к капиталу в отношении инструментов торгового портфеля, а также инструментов банковского портфеля, подверженных рыночному риску. В настоящем разделе также раскрывается информация о требованиях к собственным средствам (капиталу) по секьюритизационным требованиям (обязательствам) торгового портфеля. В настоящем разделе не раскрывается информация о требованиях к собственным средствам (капиталу) по кредитному риску контрагента в отношении требований (обязательств), раскрываемому в разделе V приложения к Указанию 4482-У.

Таблица 7.1

Величина рыночного риска при применении  
стандартизированного подхода  
на 01.07.2018

тыс. руб.

| Номер                                    | Наименование статьи                     | Величина, взвешенная по уровню риска |
|--|---|--------------------------------------|
| 1  | 2                                       | 3                                    |
| Финансовые инструменты (кроме опционов): |   |                                      |
| 1  | процентный риск (общий или специальный) | -                                    |
| 2  | фондовый риск (общий или специальный)   | -                                    |
| 3  | валютный риск                           | -                                    |
| 4  | товарный риск                           | -                                    |
| Опционы:                                 |   |                                      |
| 5  | упрощенный подход                       | -                                    |
| 6  | метод дельта-плюс                       | -                                    |
| 7  | сценарный подход                        | -                                    |
| 8  | Секьюритизация                          | -                                    |
| 9  | Всего:                                  | -                                    |

Таблица 7.2

Изменения величины требований (обязательств),  
взвешенных по уровню риска, при применении подходов  
на основе внутренней модели в целях оценки требований  
к капиталу в отношении рыночного риска  
на 01.07.2018

тыс. руб.

| Номер | Наименование статьи   | Модель расчета стоимости и под риском | Модель расчета стоимости под риском, оцененная по данным за кризисный период | Модель оценки дополнительного требования к капиталу на покрытие рыночного риска | Всеобъемлющая оценка рыночного риска | Прочее | Всего требований (обязательств), взвешенных по уровню риска |
|-------|---|---------------------------------------|--|---|--------------------------------------|--------|---|
| 1     | 2   | 3                                     | 4  | 5   | 6                                    | 7      | 8   |
| 1     | Требования (обязательства), взвешенные по уровню риска, на конец предыдущего отчетного квартала | -                                     | -  | -   | -                                    | -      | -   |
| 2     | Изменения уровня риска  | -                                     | -  | -   | -                                    | -      | -   |
| 3     | Обновления модели   | -                                     | -  | -   | -                                    | -      | -   |
| 4     | Методология и регулирование   | -                                     | -  | -   | -                                    | -      | -   |
| 5     | Приобретение и продажа  | -                                     | -  | -   | -                                    | -      | -   |
| 6     | Изменение валютных курсов   | -                                     | -  | -   | -                                    | -      | -   |
| 7     | Прочее  | -                                     | -  | -   | -                                    | -      | -   |
| 8     | Требования (обязательства), взвешенные по уровню риска, на конец отчетного квартала             | -                                     | -  | -   | -                                    | -      | -   |

Таблица 7.3

Информация о величине инструментов торгового портфеля  
при применении подходов на основе внутренней модели в целях  
расчета требований к капиталу в отношении рыночного риска  
на 01.07.2018

| Номер   | Наименование показателя                                     | Величина требований, тыс. руб. |
|---|---|--------------------------------|
| 1   | 2   | 3                              |
| Модель расчета стоимости под риском (VaR)<br>(10-дневный показатель стоимости под риском, 99-процентный доверительный интервал)   |   |                                |
| 1   | Максимальная стоимость                                      | -                              |
| 2   | Средняя стоимость   | -                              |
| 3   | Минимальная стоимость                                       | -                              |
| 4   | На конец отчетного периода                                  | -                              |
| Модель расчета стоимости под риском, оцененная по данным за кризисный период (Stressed VaR)<br>(10-дневный показатель стоимости под риском, 99-процентный доверительный интервал) |   |                                |
| 5   | Максимальная стоимость                                      | -                              |
| 6   | Средняя стоимость   | -                              |
| 7   | Минимальная стоимость                                       | -                              |
| 8   | На конец отчетного периода                                  | -                              |
| Модель оценки дополнительного требования к капиталу на покрытие рыночного риска (IRC)<br>(99,9-процентный доверительный интервал)   |   |                                |
| 9   | Максимальная стоимость                                      | -                              |
| 10  | Средняя стоимость   | -                              |
| 11  | Минимальная стоимость                                       | -                              |
| 12  | На конец отчетного периода                                  | -                              |
| Всеобъемлющая оценка требований к капиталу на покрытие рыночного риска<br>(99,9-процентный доверительный интервал)  |   |                                |
| 13  | Максимальная стоимость                                      | -                              |
| 14  | Средняя стоимость   | -                              |
| 15  | Минимальная стоимость                                       | -                              |
| 16  | На конец отчетного периода                                  | -                              |
| 17  | Предельный порог снижения риска (стандартизированный метод) | -                              |