

POPIS ČÍSELNÍKU**Kód:** BA0602**Akronym:** TRH_RIZ**Název:** Ukazatelé sledované v tržním riziku**Charakteristika:**

Ukazatele pro propočet kapitálového požadavku k tržnímu riziku

Použití číselníku v parametrech:

P0602 Ukazatelé sledované v tržním riziku

Poznámka:**Výčet položek číselníku:**

Kód	Název položky
010	<p>Celkové dlouhé pozice</p> <p>Rozlišení pozic na krátké a dlouhé pozice odpovídá čl. 328 (2) CRR.</p> <p>Pro úrokové a akciové riziko</p> <p>Vyplňuje se podle čl. 102 a 105 (1) CRR.</p> <p>Vykazují se celkové nekompenzované dlouhé pozice přes nástroje, ale po odpočtu pozic, které upsali anebo za které spoluručí třetí strany na základě formálních dohod (podle čl. 345, druhá věta).</p> <p>Pro měnové riziko</p> <p>Vykazují se celkové nekompenzované dlouhé pozice podle čl. 352 (1) CRR</p> <p>Pro komoditní riziko</p> <p>Vykazují se celkové nekompenzované dlouhé pozice podle čl. 357 (1) a (4) CRR (rovněž podle čl. 359 (1) CRR).</p> <p>Pro vlastní modely</p> <p>Vyplňuje se podle čl. 363 (1) a 367 (2) CRR. V případě vlastních modelů se celková hodnota pozic nerovná součtu hodnot rozdělených podle jednotlivých rizik. Toto rozdělení má proto povahu doplňujících položek.</p>
020	<p>Celkové krátké pozice</p> <p>Rozlišení pozic na krátké a dlouhé pozice odpovídá čl. 328 (2) CRR.</p> <p>Pro úrokové a akciové riziko</p> <p>Vyplňuje se podle čl. 102 a 105 (1) CRR.</p> <p>Vykazují se celkové nekompenzované krátké pozice přes nástroje, ale po odpočtu pozic, které upsali anebo za které spoluručí třetí strany na základě formálních dohod (podle čl. 345, druhá věta).</p> <p>Pro měnové riziko</p> <p>Vykazují se celkové nekompenzované krátké pozice podle čl. 352 (1) CRR.</p> <p>Pro komoditní riziko</p> <p>Vykazují se celkové nekompenzované krátké pozice podle čl. 357 (1) a (4) CRR (rovněž podle čl. 359 (1) CRR).</p> <p>Pro vlastní modely</p> <p>Vyplňuje se podle čl. 363 (1) a 367 (2) CRR. V případě vlastních modelů se celková hodnota pozic nerovná součtu hodnot rozdělených podle jednotlivých rizik. Toto rozdělení má proto povahu doplňujících položek.</p>

Kód	Název položky
030	Čisté dlouhé pozice Vykazují se čisté dlouhé pozice. Rozlišení pozic na krátké a dlouhé pozice odpovídá čl. 328 (2) CRR. Pro úrokové a akciové riziko Vyplňuje se podle čl. 327 až 329 a 334 CRR. Pro měnové riziko Vykazují se čisté dlouhé pozice podle čl. 352 (3) a 353 CRR. Čisté pozice se vykazují pro každou měnu separátně. Pro komoditní riziko Vykazují se čisté dlouhé pozice podle čl. 357 (4) CRR.
040	Čisté krátké pozice Rozlišení pozic na krátké a dlouhé pozice odpovídá čl. 328 (2) CRR. Pro úrokové a akciové riziko Vyplňuje se podle čl. 102 a 105 odst. (1), pro úrokové riziko též podle čl. 327 až 329 a 334 CRR Pro měnové riziko Vykazují se čisté krátké pozice podle čl. 352 (3) a 353 CRR. Pro komoditní riziko Vykazují se čisté dlouhé pozice podle čl. 357 (4) CRR.
060	Pozice pro propočet kapitálového požadavku Vyplňuje se podle části třetí hlavy IV CRR. Vykazují se čisté pozice, pro které se počítá kapitálový požadavek, a to různými přístupy uvedenými v části třetí hlavy IV, kapitole 2 (pro úrokové a akciové riziko) a kapitole 4 (pro komoditní riziko) CRR a podle čl. 352 (2) a (4), 353 a 354 CRR (měnové riziko).
070	Čisté dlouhé pozice pro propočet kapitálového požadavku
080	Čisté krátké pozice pro propočet kapitálového požadavku
090	Kompenzované pozice pro propočet kapitálového požadavku
110	Pozice odečtené z vlastního kapitálu - dlouhé
120	Pozice odečtené z vlastního kapitálu - krátké
150	Vážené čisté pozice celkem
160	Vážené čisté pozice - dlouhé
170	Vážené čisté pozice - krátké
210	Kapitálový požadavek Vykazuje se hodnota kapitálového požadavku pro jakoukoliv relevantní pozici vypočtená na základě různých přístupů podle části třetí hlavy IV, kapitoly 2 (úrokové, akciové riziko), kapitoly 3 (měnové riziko) a kapitoly 4 (komoditní riziko) CRR.

Kód	Název položky
220	Kapitálový požadavek k dodatečnému riziku selhání a migrace
230	Kapitálový požadavek k dodatečnému riziku selhání a migrace
240	Kapitálový požadavek k cenovému riziku celkem pro portfolio
250	Kapitálový požadavek k cenovému riziku celkem pro portfolio
260	Kapitálový požadavek k cenovému riziku celkem pro portfolio
270	Předpokládaný kap.požadavek k prahové hodnotě pro portfolio
280	Předpokládaný kap.požadavek k prahové hodnotě pro portfolio
290	Riziková expozice celkem Vyplňuje se podle čl. 92 (4) CRR. Vykazuje se hodnota rizikových expozic celkem odpovídající vynásobení kapitálového požadavku koeficientem 12,5.
310	VaR / Multiplikační faktor (mc) x průměr z předcházejících 6
320	VaR v předcházející den (VaRt-1)
350	Stresová hodnota VaR / Multiplikační faktor (mc) x průměr z
360	Stresová hodnota VaR / poslední dostupná hodnota (SVaRt-1)
410	Počet překročení během předcházejících 250 pracov. dnů
450	VaR multiplikační faktor (mc)
460	SVaR multiplikační faktor mc
470	Pozice pro propočet kapitálového požadavku - dlouhé Vyplňuje se podle čl. 352 (2) a (4), 353 a 354 CRR. Vykazují se čisté dlouhé pozice předmětné pro propočet kapitálového požadavku k jednotlivým měnám s výjimkou silně korelovaných. Nezahrnují se nekompenzované pozice, které se zahrnují do ostatních měn (ř. 30) jako čisté dlouhé pozice (sl. 4). Dlouhé a krátké čisté pozice pro každou měnu se počítají jako rozdíl součtu všech dlouhých pozic a součtu všech krátkých pozic.
480	Pozice pro propočet kapitálového požadavku - krátké Vyplňuje se podle čl. 352 (2) a (4), 353 a 354 CRR.

Kód	Název položky
490	Pozice pro propočet kapitálového požadavku - kompenzované Vyplňuje se podle čl. 352 (2) a (4), 353 a 354 CRR. Vykazují se čisté krátké pozice předmětné pro propočet kapitálového požadavku k silně korelovaným měnám. Nezahrnují se nekompenzované pozice, které se zahrnují do ostatních měn (ř. 30) jako čisté dlouhé pozice (sl. 4). Dlouhé a krátké čisté pozice pro každou měnu se počítají jako rozdíl součtu všech dlouhých pozic a součtu všech krátkých pozic.
S_POZICE	Souhrn pozic pro tržní riziko

Verze: 1.0
Zdroj:

Stav: Projektovaný
Garant: /

Platnost od: