Додаток 5

до Положення про порядок визначення банками України мінімального розміру ринкового ризику

(пункт 20 розділу II)

**ЧАСОВІ ДІАПАЗОНИ ТА ВАГОВІ КОЕФІЦІЄНТИ РИЗИКУ,
що застосовуються для цілей розрахунку загальноринкового ризику в складі процентного ризику торгової книги**

Таблиця

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| № з/п | Зони | Часові діапазони | Припущен­ня щодо зміни дохідності (п.п.) | Вагові коефіцієнти ризику, що беруться до розрахунку |
| для ставки купона ≥ 3% | для ставки купона < 3% | неузгоджених ризик-позицій | горизонтально узгоджених ризик- позицій |
| у межах зон 1, 2 та 3 | між зонами 1 та 2, 2 та 3 | між зонами 1 та 3 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 1 | 1 | ≤ 1 місяця | ≤ 1 місяця | 1,0 | 0,0 | 0,4 | 0,4 | 1,0 |
| 2 | Від > 1 до < 3 місяців | Від > 1 до < 3 місяців | 1,0 | 0,002 |
| 3 | Від ≥ 3 до < 6 місяців | Від ≥ 3 до < 6 місяців | 1,0 | 0,004 |
| 4 | Від ≥ 6 до < 12 місяців | Від ≥ 6 до < 12 місяців | 1,0 | 0,007 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 5 | 2 | Від ≥ 1 до < 2 років | Від ≥ 1 до < 1,9 років | 0,9 | 0,0125 | 0,3 | 0,4 | 1,0 |
| 6 | Від ≥ 2 до < 3 років | Від ≥ 1,9 до < 2,8 років | 0,8 | 0,0175 |
| 7 | Від ≥ 3 до < 4 років | Від ≥ 2,8 до < 3,6 років | 0,75 | 0,0225 |
| 8 | 3 | Від ≥ 4 до < 5 років | Від ≥ 3,6 до < 4,3 років | 0,75 | 0,0275 | 0,3 |
| 9 | Від ≥ 5 до < 7 років | Від ≥ 4,3 до < 5,7 років | 0,7 | 0,0325 |
| 10 | Від ≥ 7 до < 10 років | Від ≥ 5,7 до < 7,3 років | 0,65 | 0,0375 |
| 11 | Від ≥ 10 до < 15 років | Від ≥ 7,3 до < 9,3 років | 0,6 | 0,045 |
| 12 | Від ≥ 15 до < 20 років | Від ≥ 9,3 до < 10,6 років | 0,6 | 0,0525 |
| 13 | Від ≥ 20 років | Від ≥ 10,6 до < 12 років | 0,6 | 0,06 |
| 14 | - | Від ≥ 12 до < 20 років | 0,6 | 0,08 |
| 15 | - | Від ≥ 20 років | 0,6 | 0,125 |