

Wyniki testów wstecznych modelu wyznaczania depozytów zabezpieczających dla portfeli z okresu lipiec 2018 – czerwiec 2019 250dni.

(Results of back testing of the margin calculation model based on portfolios for the period of July 2018 – June 2019 250 days).

Opis testu <i>(Description of test)</i>	Górna granica liczby przekroczeń zgodnie z testem Kupca <i>(Maximum acceptable number of breaches in the model under the Kupiec test)</i>	Faktyczna liczba przekroczeń <i>(Actual number of breaches)</i>	Liczba obserwacji <i>(Number of observations)</i>
Testy modelu wyznaczania depozytów zabezpieczających dla rynku kasowego <i>(Testing the margin calculation model for the cash market)</i>	422	239	38 396
Testy modelu wyznaczania depozytów zabezpieczających dla rynku terminowego <i>(Testing the margin calculation model for the derivatives market)</i>	11 830	520	1 162 004
Testy modelu wyznaczania depozytów zabezpieczających dla rynku OTC <i>(Testing the margin calculation model for the OTC market)</i>	23	0	3012