

Wyniki testów wstecznych modelu wyznaczania depozytów zabezpieczających dla portfeli z okresu kwiecień 2020 – marzec 2021.

(Results of back testing of the margin calculation model based on portfolios for the period of April 2020 – March 2021).

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>	398	157	36 044
Testy modelu wyznaczania depozytów zabezpieczających dla rynku terminowego <i>(Testing the margin calculation model for the derivatives market)</i>	14 062	4 791	1 383 244
Testy modelu wyznaczania depozytów zabezpieczających dla rynku OTC <i>(Testing the margin calculation model for the OTC market)</i>	29	0	4041