

Corep Raportointiyhtä Oyj

MKR IM Details

MARKKINARISKIN SISÄINEN MALLI, LISÄTIEDOT

t-md

Perustiedot				Päivä		Viranomais-VaR						Toteumatestauksen tulokset			
Viranomais VaR-laskenta				Sisäinen VaR-laskenta		Päivien lkm (1...92)	Luottamusväli = 99 %			Eryisriskin lisäpääomavaade	Kaikki hintariskit kattava lisäpääomavaati- mus korrelaatiokaupa nkäyntisaikulle (ilman korotusta)	Sisäinen VaR	Sisäisen VaR- luvun limiitti	Hypoteettinen	Todellinen
Katetut riskialueet	Eryisriskilaskennan kattavuus osakkeet	Eryisriskilaskennan kattavuus korkosopimukset	Toteumatestaustapa	Sisäisessä VaR-laskennassa käytetty luottamusväli	Sisäisessä VaR-laskennassa käytetty pitoaika	1	VaR (T=10)	VaR (T=1)	SVaR (T=10)						
05	10	15	20	25	30	35	40	45	46	55	56	60	65	70	75
05															
10															

Rivino
 05
 10