

Corep Raportointiyhtyritys Oyj
MKR IM
t-mi

MARKKINARISKI SISÄINEN MALLI

Rivino	VaR		Stressattu VaR		Erityisriskin lisäpääomavaatimus		Kaikki hintariskit kattava lisäpääomavaatimus				Omien varojen vaatimus	Lisätiedot:				
	VaR-luvun Kerroin x edellisen 60 pankkipäivän VaR-lukujen keskiarvo	Edellisen päivän VaR-luku	Stressatun VaR-luvun Kerroin x edellisen 60 pankkipäivän stressattujen VaR-lukujen keskiarvo	Viimeisin stressattu VaR-luku	12 viikon keskimääräinen erityisriskin lisäpääomavaatimus	Viimeisin erityisriskin lisäpääomavaatimus	Lattia	12 viikon keskimääräinen kaikki hintariskit kattava lisäpääomavaatimus	Viimeisin kaikki hintariskit kattava lisäpääomavaatimus	Stressitestien perusteella vaadittava lisäpääomavaatimuksen korotus		Toteumatestausten ylitysten määrä edelliseltä 250 pankkipäivältä	VaR-luvun kerroin	Stressatun VaR-luvun kerroin	Erityisriskin omien varojen vaatimuksen yhteismäärä Korrelaatiokaupan nkäyntisalkun pitkiille positiioille	Erityisriskin omien varojen vaatimuksen yhteismäärä Korrelaatiokaupan nkäyntisalkun lyhyille positiioille
	05	10	11	12	13	14	16	17	18	19	25	30	35	36	37	38
05	YHTEENSÄ															
10	Lisätiedot: riskialueittainen jaottelu															
10 05	Korkosopimukset															
10 05 05	Korkosopimusten yleisriski															
10 05 10	Korkosopimusten erityisriski															
10 10	Osakkeet															
10 10 05	Osakkeiden yleisriski															
10 10 10	Osakkeiden erityisriski															
10 15	Valuuttakurssiriski															
10 20	Hyödykeriski															
10 25	Yleisriski yhteensä															
10 30	Erityisriski yhteensä															