Corep Raportointiyritys Oyj

MKR IM Details

t-md

INTERN MODELL FÖR MARKNADSRISK: DETALJREDOVISNING

	Allmänna uppgifter						Dag	Regelstyrt VaR							Resultat för backtesting	
	Regelstyrd VaR-beräkning				Intern VaR-beräkning		Antal dagar (1…92)	Konfidensintervall = 99 %			Extra kapitalkrav för specifik risk	Kapitalkrav för alla prisrisker (excl. förhöjningen)	Internt VaR-värde	Intern VaR-limit		
	Riskkategorier	Beräkning av specifik risk för aktier	Beräkning av specifik risk för räntekontrakt	Backtesting-metod	Konfidens-intervall för internt VaR	Innehavsperiod för internt VaR	1	VaR (T=10)	VaR (T=1)	SVaR (T=10)					Hypotetiskt	Faktiskt
Radnr	05	10	15	20	25	30	35	40	45	46	55	56	60	65	70	75
05																
10																