

Corep Raportointiyrittys Oyj  
 MKR IM  
 t-mi

INTERN MODELL FÖR MARKNADSRISK

Radnr	VaR		Stressjusterade VaR		Extra kapitalkrav för specifik risk		Kapitalkrav för alla prisrisker				Omien varojen vaatimus	Särskilda uppgifter:				
	VaR-luvun Kerroin x edellisen 60 pankkipäivän VaR-lukujen keskiarvo	Föregående dags VaR-värde	Stressjusterad VaR multiplikator x medelvärde av dagliga stressjusterade VaR-värden utifrån de närmast föregående 60 bankdagarna	Det senaste tillgängliga stressjusterade VaR-värdet	Medelvärde av extra kapitalkrav för specifik risk utifrån de närmast föregående 12 veckorna	Det senaste extra kapitalkravet för specifik risk	Golv	Medelvärde för kapitalkravet för alla prisrisker utifrån de närmast föregående 12 veckorna	Det senaste extra kapitalkravet för alla prisrisker	Tillkommande extra kapitalkrav för alla risker i korrelationshandelsportföljen utgående från resultaten av stresstesterna		Antal överskridanden under de närmast föregående 250 bankdagarna	VaR-luvun kerroin	Stressjusterad VaR multiplikator	Det sammanräknade kapitalkravet för specifika risker på de långa nettopositionerna i korrelationsportföljen	Det sammanräknade kapitalkravet för specifika risker på de korta nettopositionerna i korrelationsportföljen
	05	10	11	12	13	14	16	17	18	19	25	30	35	36	37	38
05	<b>TOTALT</b>															
10	Särskilda uppgifter: fördelning efter riskkategori															
10 05	Räntekontrakt															
10 05 05	Specifik risk i räntekontrakt															
10 05 10	Generell risk i räntekontrakt															
10 10	Aktier															
10 10 05	Specifik risk i aktier															
10 10 10	Generell risk i aktier															
10 15	Valutakursrisk															
10 20	Råvarurisk															
10 25	Generell risk totalt															
10 30	Specifik risk totalt															