

Erläuterungen zum Risikobericht der IPConcept

INHALT

1	MENÜSTRUKTUR	2
2	RISIKOBERICHT ÜBERBLICK (SEITE 1)	3
2.1	Methode & Limitierung	3
2.2	Risiko-Kontrollstatus	5
2.4	Zusammenfassung der Kennzahlen zur Beurteilung des Marktrisikos	6
2.5	Top 10 Positionen mit dem höchsten VaR-Beitrag (Component VaR)	6
2.6	Limit Breach	7
3	VALUE-AT-RISK (SEITE 2)	7
3.1	VaR-Details pro Risikofaktor	7
4	BACKTESTING (SEITE 3)	9
5	STRESSTESTS (SEITE 4)	10
5.2	ESG Szenario	11
5.3	Historische Szenarien	11