



# Erläuterungen zum Risikobericht der IPConcept

## INHALT

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