



Cartera: **ACB**

Periode: 20050101 - 20050531

## Informe Risc de Mercat

**N1 Nominal + Market**

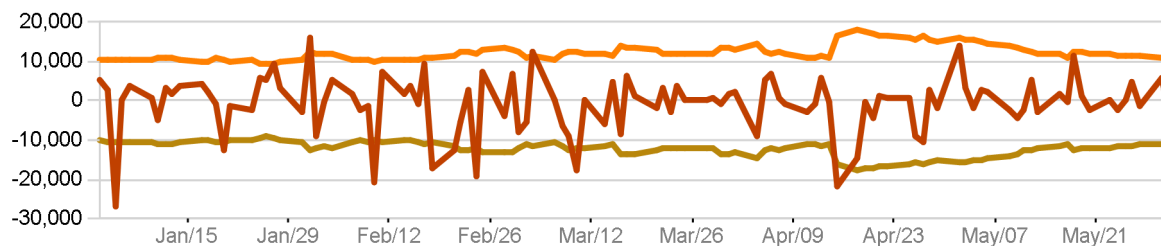
Data d'impressió: 2005/11/02 12:15:23

### Mesures de Risc

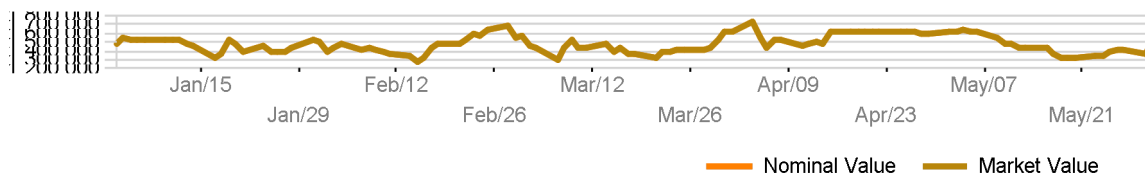
Valor nominal:	<b>1,477,998.16</b>	Valor de mercat:	<b>1,477,998.16</b>
Metode VaR:	<b>Analític</b>	VaR diari:	<b>11,501.67</b>
Horitzó temporal:	<b>1 dia</b>	VaR promig	12,190.77
Nivell de confiança:	<b>95%</b>	VaR max	17,783.81
Límit de VaR:	<b>0.00</b>	VaR min	9,197.27
		# Excessos:	8 (7.48 %)

### Evolució històrica

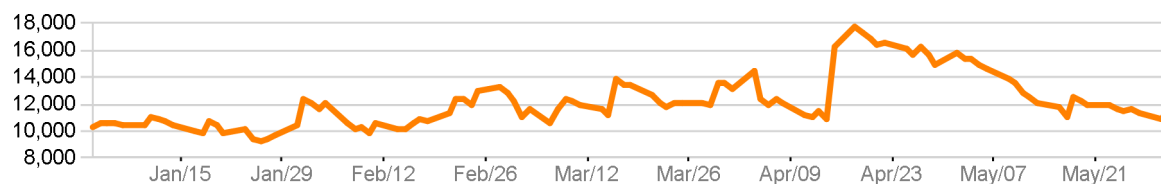
VaR diari vs PnL



Valor de mercat i valor nominal



VaR diari



### Requeriments / Consum de capital

Requeriment de capital:	51,360.91	(VaR 99% a 10 dies x 3)	
	<u>En el darrer mes</u>	<u>Desde inici de l'any</u>	<u>En el periode</u>
P & G latents (Cost):	-66,252.99	-66,252.99	-66,252.99
P & G realitzats:	0.00	0.00	0.00
P & G latents (Valor Mercat):	20,178.41	-68,047.99	-68,047.99





Cartera: **ACB**

Periode: 20050101 - 20050531

## Informe Risc de Mercat

**N1 Nominal + Market**

Data d'impressió: 2005/11/02 12:15:23

Límit de P & G: 0.00 0.00

