

FT STRESS

Følsomhedsanalyse

Indberettes af skadesforsikringselskaber, livsforsikringselskaber og tværgående pensionskasser

			SCR 125 pct.			SCR 100 pct.			MCR 125 pct.			MCR 100 pct.			Valuta	Udgangspunkt for levetidsrisici (ved intern model)
			Stress (Pct.)	Kapitalgrundlag kr.	Solvensdækning (Pct.)	Stress (Pct.)	Kapitalgrundlag kr.	Solvensdækning (Pct.)	Stress (Pct.)	Kapitalgrundlag kr.	Minimumsdækning (Pct.)	Stress (Pct.)	Kapitalgrundlag kr.	Minimumsdækning (Pct.)		
1.	Renterisici		200	130012544	185	200	130012544	185	200	130012544	450	200	130012544	450		
2.	Aktierisici		100	103281886	180	100	103281886	180	100	103281886	353	100	103281886	353		
3.	Ejendomsrisici		100	105762544	173	100	105762544	173	100	105762544	362	100	105762544	362		
4.	Kreditspændrisici	Danske statsobligationer mv. jf. § 5, nr 4) a)	27	77623146	125	35	61807479	100	45	40308056	125	49	33635822	101		
		Øvrige statsobligationer mv. jf. § 5, nr. 4) b)	100	106327604	173	100	106327604	173	100	106327604	364	100	106327604	364		
		Øvrige obligationer jf. § 5, nr. 4) c)	100	117854720	188	100	117854720	188	100	117854720	406	100	117854720	406		
5.	Valutaspændrisici	Eksposering 1	100	99572808	171	100	99572808	171	100	99572808	340	100	99572808	340	USD	
		Eksposering 2	100	129629384	204	100	129629384	204	100	129629384	448	100	129629384	448	SEK	
		Eksposering 3	100	126761532	200	100	126761532	200	100	126761532	438	100	126761532	438	GBP	
6.	Modpartsrisici		127734843	162												
7.	Levetidsrisici		100	129908708	203	100	129908708	203	100	129908708	449	100	129908708	449		UdLei
8.	Livsforsikringsoptionsrisici		StS125	KaS125	SoS125	StS100	KaS100	SoS100	StM125	KaM125	Min125	StM100	KaM100	Min100		
9.	Skadesforsikringskatastroferisici		7	121493901	99	9	118050245	80	24	93606904	108	26	90601549	98		