

Følsomhedsanalyse

Indberettes af skadeforsikringselskaber, livforsikringselskaber og tværgående pensionskasser

		SCR 125 pct.			SCR 100 pct.			MCR 125 pct.			MCR 100 pct.			Udgangspunkt for levetidensrisiko (ved intern model)	Gruppenavn	
		Stress	Kapitalgrundlag	Solvensdækning	Stress	Kapitalgrundlag	Solvensdækning	Stress	Kapitalgrundlag	Minimumsdækning	Stress	Kapitalgrundlag	Minimumsdækning			Valuta
1.	Renterisici	-2,0%	216.732.443	244,1%	-2,0%	216.732.443	244,1%	-2,0%	216.071.571	778,6%	-2,0%	216.071.571	778,6%		NRis	
2.	Aktierisici	-100,0%	174.198.371	240,8%	-100,0%	174.198.371	240,8%	-100,0%	161.540.710	582,1%	-100,0%	161.540.710	582,1%		NRis	
3.	Ejendomsrisici	-100,0%	125.924.035	185,0%	-100,0%	125.924.035	185,0%	-100,0%	99.650.535	359,1%	-100,0%	99.650.535	359,1%		FRis	
4.	Kreditspændrisici	Danske statsobligationer mv. j. § 5, nr. 4) a)	-100,0%	146.314.166	168,1%	-100,0%	146.314.166	168,1%	-100,0%	125.791.728	453,3%	-100,0%	125.791.728	453,3%		KRISa
		Øvrige statsobligationer mv. j. § 5, nr. 4) b)	-100,0%	218.300.696	246,3%	-100,0%	218.300.696	246,3%	-100,0%	218.082.152	785,9%	-100,0%	218.082.152	785,9%		KRISb
5.	Valutaspændrisici	Øvrige obligationsforhold j. § 5, nr. 4) c)	-100,0%	180.257.621	210,5%	-100,0%	180.257.621	210,5%	-100,0%	180.257.621	649,6%	-100,0%	180.257.621	649,6%	USD	VRI1
		Exponering 1	-100,0%	193.912.591	225,9%	-100,0%	193.912.591	225,9%	-100,0%	186.815.350	673,2%	-100,0%	186.815.350	673,2%		VRI2
		Exponering 2	-100,0%	215.770.150	244,3%	-100,0%	215.770.150	244,3%	-100,0%	214.837.862	774,2%	-100,0%	214.837.862	774,2%	JPY	VRI3
		Exponering 3	-100,0%	217.163.988	245,4%	-100,0%	217.163.988	245,4%	-100,0%	216.624.834	780,6%	-100,0%	216.624.834	780,6%	GBP	
6.	Modpartorisici		202.776.904	225,7%											NRis	
7.	Levetidensrisici	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A		NRis	
8.	Livforsikringsoptionsrisici	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A		NRis	
9.	Katastrofe	3	138.281.541	155,8%	3	138.281.541	155,8%	3	115.493.491	416,2%	3	115.493.491	416,2%		Katast	