

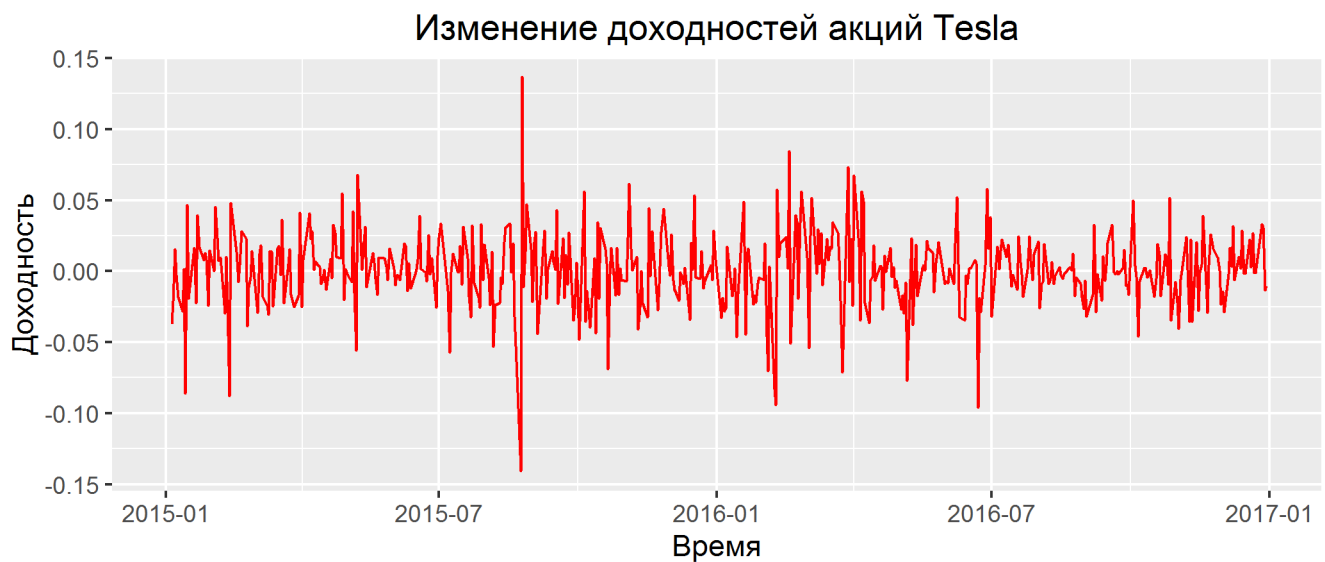
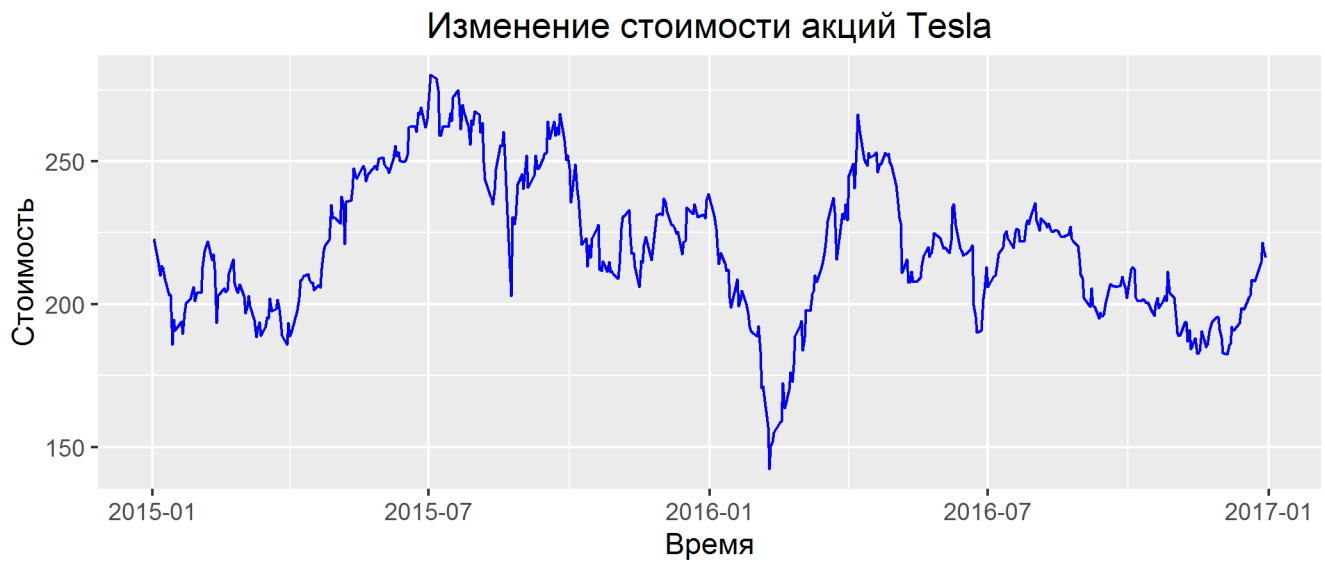
Отчёт о расчёте VaR по ПАО "Альфа-Банк"

Винни-Пух

4 апреля 2017 г.

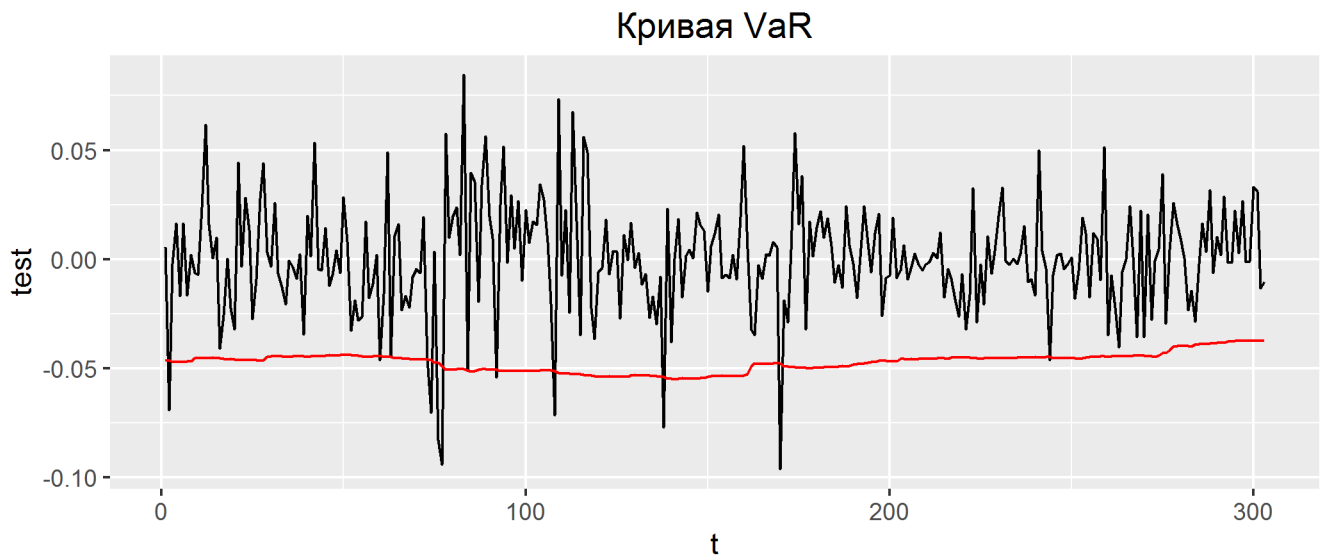
1. VaR

В данном отчёте рассчитываются VaR. Делается это с помощью нормального распределения. Реалистичность расчётов проверяется с помощью теста Купика.



VaR = -0.0438916

2. Адекватность расчёта VaR



p – value для теста Купика равно 25.11 %. Наш прогноз хороший, так как гипотеза о том, что число пробитий не превышает 5%, не отвергается. Прогноз заверен Купиком!

3. Проверка гипотезы единичного корня. Расширенный тест Дики-Фуллера

Таблица 1: Результаты теста

parametr	value
statistic	-7.72
lag order	7
alternative	stationary
p-value	0.01

_____ Пятачок