

**CB 8: RISICOBEHEER**

Dekkingstesten	scenario		inkomsten	uitgaven	totaal	waarde dekkingsactiva (artikel 6 KB)	waarde primaire dekkingsactiva (artikel 6 KB)	nominale waarde covered bonds
		0	5	10	15	20	25	30
Stresstest 1	15%RE2xPD	5	12 098 580 245,37	-10 501 623 658,93	1 596 956 586,43	10 542 785 031,83	10 384 261 301,28	9 492 000 000,00
Stresstest 2	30%RE3xPD	10	11 929 007 183,02	-10 501 623 658,93	1 427 383 524,08	10 241 171 792,38	10 082 648 061,83	9 492 000 000,00
Stresstest 3	int-2%	15	12 171 186 213,60	-10 494 944 424,29	1 676 241 789,31	10 609 290 135,03	10 450 766 404,48	9 492 000 000,00
Stresstest 4	int+2%	20	12 492 991 665,26	-10 501 779 408,75	1 991 212 256,51	10 609 290 135,03	10 450 766 404,48	9 492 000 000,00
Stresstest 5		25						
Stresstest 6		30						
Stresstest 7		35						
...		40						
Stresstest X		100						

Liquiditeitstest	scenario		instromen	uitstromen	totaal
		35	40	45	50
Stresstest 1	15%RE2xPD	5	782 750 533,29	-49 545 956,76	733 204 576,52
Stresstest 2	30%RE3xPD	10	782 076 854,10	-49 545 956,76	732 530 897,34
Stresstest 3	int-2%	15	783 225 397,15	-49 545 893,52	733 679 503,63
Stresstest 4	int+2%	20	784 474 267,38	-49 545 998,67	734 928 268,71
Stresstest 5		25			
Stresstest 6		30			
Stresstest 7		35			
...		40			
Stresstest X		100			