

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						
		35						
		40						
		100						
Stresstest 1	2xPD	5	1 957 358 400,03	-1 337 084 191,89	620 274 208,15	1 689 779 786,28	1 681 777 872,53	1 211 000 000,00
Stresstest 2	3xPD	10	1 950 545 741,76	-1 337 084 191,89	613 461 549,87	1 689 779 786,28	1 681 777 872,53	1 211 000 000,00
Stresstest 3	int-2%	15	1 959 576 980,13	-1 337 084 191,89	622 492 788,24	1 689 779 786,28	1 681 777 872,53	1 211 000 000,00
Stresstest 4	int+2%	20	1 999 408 524,51	-1 337 084 191,89	662 324 332,62	1 689 779 786,28	1 681 777 872,53	1 211 000 000,00
Stresstest 5		25						
Stresstest 6		30						
Stresstest 7		35						
...		40						
Stresstest X		100						

Liquiditeitstest	scenario		instromen	uitstromen	totaal
		35			
		40			
		45			
		50			
Stresstest 1	2xPD	5	123 605 784,76	-1 542 422,92	122 063 361,84
Stresstest 2	3xPD	10	123 584 644,75	-1 542 422,92	122 042 221,82
Stresstest 3	int-2%	15	123 516 367,65	-1 542 422,92	121 973 944,73
Stresstest 4	int+2%	20	123 779 579,46	-1 542 422,92	122 237 156,54
Stresstest 5		25			
Stresstest 6		30			
Stresstest 7		35			
...		40			
Stresstest X		100			