

**CB 8: RISICOBEEHER**

Dekkingstesten	scenario		inkomsten	uitgaven	totaal	waarde dekkingactiva (artikel 6 KB)	waarde primaire dekkingactiva (artikel 6 KB)	nominale waarde covered bonds
		0	5	10	15	20	25	30
Stresstest 1	2xPD	5	1 970 224 731,81	-1 337 661 683,28	632 563 048,53	1 686 758 082,58	1 678 747 915,18	1 211 000 000,00
Stresstest 2	3xPD	10	1 962 958 431,10	-1 337 661 683,28	625 296 747,83	1 686 758 082,58	1 678 747 915,18	1 211 000 000,00
Stresstest 3	int-2%	15	1 962 243 084,97	-1 337 661 683,28	624 581 401,70	1 686 758 082,58	1 678 747 915,18	1 211 000 000,00
Stresstest 4	int+2%	20	2 008 231 825,23	-1 337 661 683,28	670 570 141,95	1 686 758 082,58	1 678 747 915,18	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	113 870 990,02	-3 062 150,86	110 808 839,16
Stresstest 2	3xPD	10	113 733 385,87	-3 062 150,86	110 671 235,00
Stresstest 3	int-2%	15	114 044 716,79	-3 062 150,86	110 982 565,93
Stresstest 4	int+2%	20	114 252 225,38	-3 062 150,86	111 190 074,51
Stresstest 5		25			
Stresstest 6		30			
Stresstest 7		35			
...		40			
Stresstest X		100			