

CB 8 : RISICOBEEHEER

Dekkingstesten	Scenario		inkomsten	uitgaven	totaal	waarde dekkingsactiva (art. 6 KB)	waarde primaire dekkingsactiva (art. 6 KB)	nominale waarde covered bonds
	0		5	10	15	20	25	30
Stresstest 1	2xPD	5	2.803.402.397,10	-1.987.203.668,61	816.198.728,5	2.345.132.608,90	2.318.541.695,70	1.711.000.000,00
Stresstest 2	3xPD	10	2.786.744.643,23	-1.987.203.668,61	799.540.974,62	2.345.132.608,90	2.318.541.695,70	1.711.000.000,00
Stresstest 3	int-2%	15	2.807.847.055,66	-1.987.203.668,61	820.643.387,05	2.345.132.608,90	2.318.541.695,70	1.711.000.000,00
Stresstest 4	int+2%	20	2.869.050.753,20	-1.987.203.668,61	881.847.084,6	2.345.132.608,90	2.318.541.695,70	1.711.000.000,00
Stresstest 5		25						
Stresstest 6		30						
Stresstest 7		35						
Stresstest 8		40						
Stresstest 9		45						
Stresstest 10		50						
Stresstest 11		55						
Stresstest 12		60						
Stresstest 13		65						
Stresstest 14		70						
Stresstest 15		75						
Stresstest 16		80						
Stresstest 17		85						
Stresstest 18		90						
Stresstest 19		95						
Stresstest 20		100						

Liquiditeitstest	Scenario		instromen	uitstromen	totaal
	35		40	45	50
Stresstest 1	2xPD	5	155.533.002,61	-5.443.787,41	150.089.215,20
Stresstest 2	3xPD	10	155.498.963,20	-5.443.787,41	150.055.175,78
Stresstest 3	int-2%	15	155.471.585,71	-5.443.787,41	150.027.798,30
Stresstest 4	int+2%	20	155.730.136,27	-5.443.787,41	150.286.348,86
Stresstest 5		25			
Stresstest 6		30			
Stresstest 7		35			
Stresstest 8		40			
Stresstest 9		45			
Stresstest 10		50			
Stresstest 11		55			
Stresstest 12		60			
Stresstest 13		65			
Stresstest 14		70			
Stresstest 15		75			
Stresstest 16		80			
Stresstest 17		85			
Stresstest 18		90			
Stresstest 19		95			
Stresstest 20		100			