2025/379

12.3.2025

KOMMISSIONENS GENNEMFØRELSESFORORDNING (EU) 2025/379

af 26. februar 2025

om ændring af de gennemførelsesmæssige tekniske standarder i gennemførelsesforordning (EU) 2016/2070 for så vidt angår benchmarkporteføljer, indberetningsskemaer og indberetningsinstrukser, der skal anvendes i Unionen med henblik på den indberetning, der er omhandlet i artikel 78, stk. 2, i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2013/36/EU

(EØS-relevant tekst)

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2013/36/EU af 26. juni 2013 om adgang til at udøve virksomhed som kreditinstitut og om tilsyn med kreditinstitutter, om ændring af direktiv 2002/87/EF og om ophævelse af direktiv 2006/48/EF og 2006/49/EF ([1]), særlig artikel 78, stk. 8, tredje afsnit, og

ud fra følgende betragtninger:

(1) I henhold til artikel 78, stk. 1, i direktiv 2013/36/EU skal institutter med tilladelse til at benytte interne metoder med passende mellemrum og mindst én gang om året forelægge deres kompetente myndighed resultaterne af beregningerne af deres risikovægtede eksponeringsbeløb eller kapitalgrundlagskrav efter deres interne metoder for eksponeringer eller positioner, som indgår i benchmarkporteføljerne, for at sætte den kompetente myndighed i stand til at vurdere kvaliteten af disse interne metoder (»benchmarking«). I henhold til artikel 78, stk. 3, andet afsnit, i nævnte direktiv skal Den Europæiske Banktilsynsmyndighed (»EBA«) udarbejde en rapport til støtte for de kompetente myndigheders vurdering af kvaliteten af institutternes interne metoder baseret på resultaterne af benchmarkingen. Indberetningskravene til benchmarkingen er fastlagt i Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2016/2070 ([2]), som er blevet ændret adskillige gange. For at afspejle det ændrede fokus i myndighedernes vurderinger og EBA's rapporter og i lyset af de lovgivningsmæssige ændringer på markedsrisikoområdet, er der behov for at ajourføre benchmarkporteføljerne samt de indberetningskrav, der er fastsat i nævnte gennemførelsesforordning.

(2) Instrukserne for benchmarking af kreditrisiko bør ændres for at præcisere, at indberetning af sandsynligheden for misligholdelse (PD) og parametrene for tab i tilfælde af misligholdelse (LGD) er obligatoriske med hensyn til forsigtighedsmargenen (MoC), obligatoriske tillæg og komponenterne for nedgangsperioden (DWC), som kan være en kilde til forskelle i modellerne. Det bør ydermere præciseres, at institutterne har pligt til at indberette den modelidentifikator, som er tildelt af den kompetente myndighed, hvilket letter operationaliseringen af den indberetningsmæssige fordeling af data.

(3) Ved Kommissionens delegerede forordning (EU) 2024/2795 ([3]) blev anvendelsesdatoen for kapitalgrundlagskravene vedrørende markedsrisiko udsat. Derfor erstattes skemaerne for den eksisterende metode med interne modeller ikke i denne øvelse. Parallelt hermed bør skemaerne til validering af standardmetoden udvides til at omfatte flere porteføljer end 2024-øvelsen, hvor kun renteinstrumenterne var omfattet. Dette har til formål at sikre passende tilsyn og en gnidningsfri gennemførelse af den nye standardmetode, som anvendes til beregning af outputgulvet.

([1]) EUT L 176 af 27.6.2013, s. 338, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj.

([2]) Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2016/2070 af 14. september 2016 om gennemførelsesmæssige tekniske standarder for de skemaer, definitioner og IT-løsninger, som institutterne skal anvende, når de indberetter til Den Europæiske Banktilsynsmyndighed og til kompetente myndigheder i henhold til artikel 78, stk. 2, i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2013/36/EU (EUT L 328 af 2.12.2016, s. 1. ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) Kommissionens delegerede forordning (EU) 2024/2795 af 24. juli 2024 om ændring af Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 for så vidt angår anvendelsesdatoen for kapitalgrundlagskravene vedrørende markedsrisiko (EUT L, 2024/2795, 31.10.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) Gennemførelsesforordning (EU) 2016/2070 bør derfor ændres.

(5) Denne forordning er baseret på det udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, som EBA har forelagt Kommissionen.

(6) EBA har gennemført åbne offentlige høringer om udkastene til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, som ligger til grund for denne forordning, analyseret de dermed forbundne potentielle omkostninger og fordele samt anmodet interessentgruppen for banker, som er nedsat i henhold til artikel 37 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1093/2010 ([4]), om rådgivning —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

I gennemførelsesforordning (EU) 2016/2070 foretages følgende ændringer:

1) Bilag IV erstattes af teksten i bilag I til nærværende forordning

2) Bilag V erstattes af teksten i bilag II til nærværende forordning

3) Bilag VI erstattes af teksten i bilag III til nærværende forordning

4) Bilag VII erstattes af teksten i bilag IV til nærværende forordning

5) Bilag X erstattes af teksten i bilag V til nærværende forordning.

Artikel 2

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 26. februar 2025.

På Kommissionens vegne
Ursula VON DER LEYEN
Formand

([4]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1093/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Banktilsynsmyndighed), om ændring af afgørelse nr. 716/2009/EF og om ophævelse af Kommissionens afgørelse 2009/78/EF (EUT L 331 af 15.12.2010, s. 12, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

BILAG I

»BILAG IV

RESULTATER FOR BENCHMARKPORTEFØLJER MED HENBLIK PÅ TILSYN

DEL I: GENERELLE INSTRUKSER

DEL II: INSTRUKSER VEDRØRENDE SKEMAERNE

C 101 — Oplysninger om eksponeringer i porteføljer med lav misligholdelsesrisiko (LDP) efter modpart

C 102 — Oplysninger om eksponeringer i porteføljer med lav misligholdelsesrisiko

C 103 — Oplysninger om eksponeringer i porteføljer med høj misligholdelsesrisiko

C 105.01 — Definition af interne modeller

C 105.02 — Kobling mellem interne modeller og porteføljer

C 105.03 — Kobling mellem interne modeller og lande

DEL I: GENERELLE INSTRUKSER

1. Der skal kun indberettes oplysninger for de modparter og porteføljer, for hvilke der findes en faktisk eksponering på referencedatoen i form af enten en oprindelig eksponering eller en eksponering efter kreditrisikoreduktionsteknikker. Modparter og porteføljer, for hvilke der ikke findes en eksponering på referencedatoen, indberettes ikke.

2. Der skal kun indberettes oplysninger for de eksponeringer, for hvilke den kompetente myndighed har godkendt en intern model til beregning af risikovægtede eksponeringsbeløb (»RWA«). Modpartskoder, der slutter på »STDA«, indberettes ikke i skema C 101. For de resterende modpartskoder i skema C 101 i bilag I og for de benchmarkporteføljer, der er omhandlet i skema C 102 og C 103, udelades eksponeringer opgjort i henhold til standardmetoden og eksponeringer, for hvilke den relevante kompetente myndighed har tilladt midlertidig eller permanent delvis anvendelse af standardmetoden.

3. De felter, som indeholder ikke-relevante eller vagt definerede oplysninger, skal enten stå tomme eller udfyldes med angivelsen »NULL«. Dette gælder også eksponering ved misligholdelse (EAD)-vægtede mængder eller parametre, der ikke kan beregnes. På samme måde kan datafelter, hvor der ikke er krav om indberetning, stå tomme eller udfyldes med angivelsen »NULL«. Nulværdier indberettes kun, hvis hensigten er at indberette en mængde eller et parameter fastsat til nul. Hverken angivelsen »tom« eller »NULL« anvendes til at indberette mængder eller parametre fastsat til nul.

4. Pengebeløb indberettes på samme måde, som de indberettes ved beregningen af kapitalgrundlagskrav på en bestemt referencedato i overensstemmelse med Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2021/451 ([1]).

([1]) Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2021/451 af 17. december 2020 om gennemførelsesmæssige tekniske standarder for anvendelsen af Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 for så vidt angår institutters indberetning med henblik på tilsyn og om ophævelse af gennemførelsesforordning (EU) nr. 680/2014 (EUT L 97 af 19.3.2021, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

DEL II: INSTRUKSER VEDRØRENDE SKEMAERNE

C 101 — Oplysninger om eksponeringer i porteføljer med lav misligholdelsesrisiko (LDP) efter modpart

Eksponeringer relateret til specialiseret långivning udelades.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Modpartskode	Kolonne 0010 i skema C 101 i bilag I	Her indberettes den modpartskode, der i kolonne 0010 i skema C 101 i bilag I definerer modparten i de stikprøveudvalgte LPD-porteføljer. Koden er en ID-kode for rækken og skal være unik for hver enkelt række i skemaet.
0020	Eksponerings-klasse	Punkt 76 i bilag II til gennemførelsesfor-ordning (EU) 2021/451	Hver modpart henføres til en af følgende eksponeringsklasser: a) centralbanker og centralregeringer b) institutter c) selskaber — SMV'er (små og mellemstore virksomheder) d) selskaber — specialiseret långivning e) selskaber — andre: f) detail — sikret ved pant i fast ejendom SMV'er g) detail — sikret ved pant i fast ejendom ikke-SMV'er h) detail — kvalificerede revolverende i) detail — andre SMV'er j) detail — andre ikke-SMV'er k) ikke relevant. »Ikke relevant« anvendes, når ingen af svarene på listen er relevante, hvilket er tilfældet, når eksponeringerne mod en modpart er klassificeret i flere eksponeringsklasser, hvor ingen af dem tydeligvis er den mest fremtrædende.
0040	Rating		Rækkefølgen efter den interne rating, som er tildelt modparten i overensstemmelse med instituttets system med interne ratingskalaer, skal indberettes. Den skal være i nummerorden (1, 2, 3 osv.) fra laveste risiko til højeste risiko, ekskl. misligholdelser med en PD svarende til 100 %. Hvis et institut benytter en kontinuerlig ratingskala i henhold til artikel 169, stk. 3, i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 ([2]), anvendes ratingklasserne som angivet i kolonne 0005 i skema C 08.02 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451. Når eksponeringer mod en modpart er blevet henført til forskellige ratingklasser i henhold til artikel 172, stk. 1, litra e), nr. i) eller iii), i forordning (EU) nr. 575/2013, indberettes ratingklasse nul (0).

([2]) Europa-parlamentets og rådets forordning (EU) nr. 575/2013 af 26. juni 2013 om tilsynsmæssige krav til kreditinstitutter og investeringsselskaber og om ændring af forordning (EU) nr. 648/2012 (EUT L 176 af 27.6.2013, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0050	Dato for seneste rating af modpart		Her indberettes datoen for den seneste rating af modparten.
0060	PD	Skema C 08.01, kolonne 0010, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes den PD, der er tildelt modparten. PD'en er den PD, der anvendes til at beregne RWA, ekskl. virkningen af foranstaltninger i overensstemmelse med artikel 458 i forordning (EU) nr. 575/2013. PD skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1.
0070	Status for misligholdelse		Her indberettes modpartens misligholdelsesstatus, som skal være en af følgende i overensstemmelse med artikel 178 i forordning (EU) nr. 575/2013: a) misligholdt b) ikkemisligholdt.
0080	Oprindelig eksponering før anvendelse af konverteringsfaktorer	Skema C 08.01, kolonne 0020, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes den oprindelige eksponeringsværdi inden indregning af værdijusteringer, hensættelser, virkninger af kreditrisikoreduktionsteknikker eller konverteringsfaktorer.
0090	Eksponering efter substitutionsvirkninger af kreditrisikoreduktionsteknikker før anvendelse af konverteringsfaktorer	Skema C 08.01, kolonne 0090, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes det beløb, som kreditkonverteringsfaktorer anvendes på for at nå frem til eksponering ved misligholdelse (kolonne 0110). Det skal gøres under hensyntagen til kreditrisikoreduktionsteknikker med substitutionsvirkninger for eksponeringen.
0100	Kreditkonverteringsfaktor	Artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013	Det vægtede gennemsnit af kreditkonverteringsfaktorerne indberettes. De anvendte vægte er de beløb, som kreditkonverteringsfaktorerne anvendes på for at nå frem til eksponering ved misligholdelse. For modparter, hvis faciliteter udelukkende svarer til de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013, skal det indberettede vægtede gennemsnit af kreditkonverteringsfaktorerne baseres på samtlige faciliteter. For modparter, hvis faciliteter ikke hører ind under de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013 skal kreditkonverteringsfaktorerne enten stå tomt, eller udfyldes med angivelsen »NULL«.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			For modparter, hvis faciliteter svarer til de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013, og hvis faciliteter ikke hører ind under de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i nævnte forordning, skal det indberettede vægtede gennemsnit af kreditkonverteringsfaktoren kun baseres på de faciliteter, der svarer til de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013. Faciliteter svarende til de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 10, i nævnte forordning skal navnlig ikke tages i betragtning ved beregningen. Hvis instituttet anvender egne estimater af kreditkonverteringsfaktorer for de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013, anvendes disse kreditkonverteringsfaktorer til at beregne det vægtede gennemsnit af kreditkonverteringsfaktorerne. Hvis instituttet ikke anvender egne estimater af kreditkonverteringsfaktorer for de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013, anvendes de obligatoriske kreditkonverteringsfaktorer i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013. Kreditkonverteringsfaktoren skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1.
0110	Eksponering ved misligholdelse	Skema C 08.01, kolonne 0110, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes eksponeringsværdien.
0120	Værdi af sikkerhedsstillelse	Skema C 08.01, kolonne 0150 til 0210, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes markedsværdien af sikkerhedsstillelsen.
0130	Hyp LGD ikke-efterstillede usikrede uden negativerklæring	Artikel 161 i forordning (EU) nr. 575/2013	De hypotetiske egne estimater af tab givet misligholdelse (»LGD«), der ville blive anvendt af instituttet på eksponeringerne mod modparten, indberettes i overensstemmelse med følgende: (a) omfanget af eksponeringerne er det samme som for den i kolonne 0150 indberettede LGD-værdi (b) eksponeringerne er ikke efterstillede og er usikrede (c) der foreligger ikke en klausul om negativerklæring. En negativerklæring er en erklæring om, at låntageren eller gældsudstederen ikke vil pantsætte sine aktiver over for en anden part.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0140	Hyp LGD ikke-efterstillede usikrede med negativerklæring	Artikel 161 i forordning (EU) nr. 575/2013	De hypotetiske egne estimater af LGD, der ville blive anvendt af instituttet på eksponeringerne mod modparten, indberettes i overensstemmelse med følgende: (a) omfanget af eksponeringerne er det samme som for den i kolonne 0150 indberettede LGD-værdi (b) eksponeringerne er ikke efterstillede og er usikrede (c) der foreligger en klausul om negativerklæring. En negativerklæring er en erklæring om, at låntageren eller gældsudstederen ikke vil pantsætte sine aktiver over for en anden part.
0150	LGD	Skema C 08.01, kolonne 0230 og 0240, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Det EAD-vægtede gennemsnit af LGD-værdierne af eksponeringerne mod modparten i de respektive porteføljer indberettes. LGD'erne skal være dem, som anvendes til beregningen af RWA. Hvis instituttet har opnået tilladelse fra sin kompetente myndighed til at anvende egne estimater for LGD'er, baseres LGD'erne på instituttets egne estimater, ellers skal LGD'erne baseres på de obligatoriske LGD-værdier under hensyntagen til gældende risikoreduktionsteknikker. LGD'er for store regulerede enheder i den finansielle sektor og uregulerede finansielle enheder i den finansielle sektor medtages. Virkningen af foranstaltninger, der er indført i overensstemmelse med artikel 458 i forordning (EU) nr. 575/2013, medtages ikke. LGD skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1.
0160	Løbetid	Skema C 08.01, kolonne 0250, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Den EAD-vægtede løbetid for eksponeringerne mod modparten indberettes. Den udtrykkes i antal dage.
0170	RWA	Skema C 08.01, kolonne 0260, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	RWA efter støttefaktorer (støttefaktorer for SMV'er og infrastruktur) indberettes. RWA omfatter ikke virkningen af mulige foranstaltninger i henhold til artikel 458 i forordning (EU) nr. 575/2013.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 102 — Oplysninger om eksponeringer i porteføljer med lav misligholdelsesrisiko

For porteføljer, der er anført i bilag I med en anden status for sikkerhedsstillelse end »ikke relevant«, kan følgende oplysninger udelades, når den godkendte model ikke tager højde for forskellige LGD-beregninger for sikrede og usikrede dele af en eksponering: LGD (kolonne 0130), LGD uden tilsynsforanstaltninger (kolonne 0131), LGD uden forsigtighedsmargen (MoC) og tilsynsforanstaltninger (kolonne 0132), LGD uden MoC, tilsynsforanstaltninger og komponent for nedgangsperioden (kolonne 0133), forventet tab (kolonne 0150) og RWA (kolonne 0170).

For porteføljer med den obligatoriske fremgangsmåde »Kategoriseringskriterier for specialiseret långivning« skal følgende oplysninger udelades: PD (kolonne 0060), PD uden tilsynsforanstaltninger (kolonne 0061), PD uden MoC og tilsynsforanstaltninger (kolonne 0062), LGD (kolonne 0130), LGD uden tilsynsforanstaltninger (kolonne 0131), LGD uden MoC og tilsynsforanstaltninger (kolonne 0132), LGD uden MoC, tilsynsforanstaltninger og komponent for nedgangsperioden (kolonne 0133).

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Porteføljе-ID	Kolonne 0010 i skema C102 i bilag I	Det porteføljе-ID, der i kolonne 0010 i skema C.102 i bilag I definerer porteføljen, indberettes her. Dette ID er en ID-kode for rækken og skal være unik for hver enkelt række i skemaet. Henførelsen af eksponeringer til porteføljе-ID'er er ikke eksklusiv: Eksponeringer eller dele af eksponeringer skal indberettes under alle relevante porteføljе-ID'er.
0040	Antal låntagere		Her indberettes antallet af låntagere. Det skal være baseret på låntagere, for hvilke der er indberettet en strengt positiv værdi enten i kolonne 0080 eller 0090. Hvis der anvendes en fuld substitution på grund af en kreditrisikoreduktionsteknik, tilføjes den oprindelige låntager til »Antal låntagere« for dens oprindelige portefølje, og garanten tilføjes til »Antal låntagere« for garantporteføljen.
0060	PD	Skema C08.01, kolonne 0010, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	PD'en er den PD, der anvendes til at beregne RWA, ekskl. virkningen af mulige foranstaltninger, der kan være indført i overensstemmelse med artikel 458 i forordning (EU) nr. 575/2013. For porteføljer, der svarer til en individuel klasse eller pulje, skal den PD, der er tildelt den specifikke låntagerklasse eller -pulje, indberettes. For porteføljer, der svarer til en aggregering af låntagere i forskellige klasser eller puljer, anføres det EAD-vægtede gennemsnit af de PD'er, der er tildelt eksponeringerne i aggregeringen. PD skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1.
0061	PD uden tilsynsforanstaltninger		PD'en uden tilsynsforanstaltninger er den PD, der er baseret på bestemmelserne i artikel 179 og 180 i forordning (EU) nr. 575/2013, som indeholder den forsigtighedsmargen (»MoC«), der er tilføjet af instituttet, men udelukker foranstaltninger (multiplikatorer, tillæg, bundgrænser eller lignende foranstaltninger, der direkte øger PD'en), der er pålagt af de kompetente myndigheder. For porteføljer, der svarer til en individuel klasse eller pulje, indberettes PD'en for den klasse, der indeholder MoC'en, men som ekskluderer tilsynsforanstaltningerne. For porteføljer, der svarer til en aggregering af låntagere i forskellige klasser eller puljer, indberettes det EAD-vægtede gennemsnit af PD'erne for de respektive eksponeringer, der indeholder MoC'erne, men som ekskluderer tilsynsforanstaltningerne. PD'en uden tilsynsforanstaltninger skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1. Hvis instituttet ikke er i stand til at isolere de relevante forsigtighedsjusteringer, finder del I, punkt 3, anvendelse.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0062	PD uden MoC og tilsynsforanstaltninger		PD'en uden MoC og tilsynsforanstaltninger er den PD, der hverken inkluderer den MoC, der er tilføjet af instituttet i overensstemmelse med artikel 179, stk. 1, litra f), og artikel 180, stk. 1, litra e), i forordning (EU) nr. 575/2013, eller virkningen af foranstaltninger, der er indført af de kompetente myndigheder (multiplikatorer, tillæg, bundgrænser eller lignende foranstaltninger, der direkte øger PD'en). For porteføljer, der svarer til en individuel klasse eller pulje, indberettes PD'en for den klasse, der ekskluderer MoC'en og ekskluderer tilsynsforanstaltningerne. For porteføljer, der svarer til en aggregering af låntagere i forskellige klasser eller puljer, indberettes det EAD-vægtede gennemsnit af PD'erne for de respektive eksponeringer, der ekskluderer MoC'erne og ekskluderer tilsynsforanstaltninger. PD'en uden MoC og tilsynsforanstaltninger skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1. Hvis instituttet ikke er i stand til at isolere de relevante forsigtighedsjusteringer, finder del I, punkt 3, anvendelse.
0080	Oprindelig eksponering før anvendelse af konverteringsfaktorer	Skema C08.01, kolonne 0020, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes den oprindelige eksponeringsværdi inden indregning af værdijusteringer, hensættelser, virkninger af kreditrisikoreduktionsteknikker eller konverteringsfaktorer.
0090	Eksponering efter substitutionsvirkninger af kreditrisikoreduktionsteknikker før anvendelse af konverteringsfaktorer	Skema C08.01, kolonne 0090, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes det beløb, som kreditkonverteringsfaktorer anvendes på for at nå frem til eksponering ved misligholdelse (kolonne 0110). Det skal gøres under hensyntagen til kreditrisikoreduktionsteknikker med substitutionsvirkninger for eksponeringen.
0100	Kreditkonverteringsfaktor	Artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013	Det vægtede gennemsnit af kreditkonverteringsfaktorerne indberettes. De anvendte vægte er de beløb, som kreditkonverteringsfaktorerne anvendes på for at nå frem til eksponering ved misligholdelse. For porteføljer med faciliteter, der udelukkende svarer til de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013, skal det indberettede vægtede gennemsnit af kreditkonverteringsfaktorerne baseres på samtlige faciliteter. For porteføljer med faciliteter, hvoraf ingen hører ind under de poster, der er nævnt i artikel 166 i forordning (EU) nr. 575/2013, skal feltet for kreditkonverteringsfaktorer enten stå tomt eller udfyldes med angivelsen »NULL«. For porteføljer med faciliteter, der svarer til de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013, og hvis faciliteter ikke hører ind under de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i nævnte forordning, skal det indberettede vægtede gennemsnit af kreditkonverteringsfaktoren kun baseres på de faciliteter, der svarer til de poster, der er nævnt i artikel 166,

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013. Faciliteter svarende til de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 10, i nævnte forordning skal navnlig ikke tages i betragtning ved beregningen. Hvis instituttet anvender egne estimater af kreditkonverteringsfaktorer for de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013, anvendes disse kreditkonverteringsfaktorer til at beregne det vægtede gennemsnit af kreditkonverteringsfaktorerne. Hvis instituttet ikke anvender egne estimater af kreditkonverteringsfaktorer for de poster, der er nævnt i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013, anvendes de obligatoriske kreditkonverteringsfaktorer i artikel 166, stk. 8, i forordning (EU) nr. 575/2013. Kreditkonverteringsfaktoren skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1.
0110	Eksponering ved misligholdelse	Skema C08.01, kolonne 0110, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes eksponeringsværdien.
0120	Værdi af sikkerhedsstillelse	Skema C08.01, kolonne 0150 til 0210, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes markedsværdien af sikkerhedsstillelsen.
0130	LGD	Skema C08.01, kolonne 0230 og 0240, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Det EAD-vægtede gennemsnit af LGD-værdierne af eksponeringerne i de respektive porteføljer indberettes. LGD'erne skal være dem, som anvendes til beregningen af RWA. Hvis instituttet har opnået tilladelse fra sin kompetente myndighed til at anvende egne estimater for LGD'er, baseres LGD'erne på instituttets egne estimater, ellers skal LGD'erne baseres på de obligatoriske LGD-værdier under hensyntagen til gældende risikoreduktionsteknikker. Eksponeringer og de respektive LGD'er for store enheder i den finansielle sektor og uregulerede finansielle enheder medtages. Virkningen af foranstaltninger, der er indført i overensstemmelse med artikel 458 i forordning (EU) nr. 575/2013, medtages ikke. LGD skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0131	LGD uden tilsynsforanstaltninger		LGD'en uden tilsynsforanstaltninger er den LGD, der er baseret på bestemmelserne i artikel 179 og 181 i forordning (EU) nr. 575/2013, som indeholder den MoC, der er tilføjet af instituttet, men udelukker foranstaltninger (multiplikatorer, tillæg, bundgrænser eller lignende foranstaltninger, der direkte øger LGD'en), der er pålagt af de kompetente myndigheder. For porteføljer, der svarer til en individuel klasse eller pulje, indberettes LGD'en for den klasse, der indeholder MoC'en, men som ekskluderer tilsynsforanstaltningerne. For porteføljer, der svarer til en aggregering af låntagere i forskellige klasser eller puljer, indberettes det EAD-vægtede gennemsnit af LGD'erne for de respektive eksponeringer, der indeholder MoC'erne, men som ekskluderer tilsynsforanstaltningerne. LGD'en uden tilsynsforanstaltninger skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1. Hvis instituttet ikke er i stand til at isolere de relevante forsigtighedsjusteringer, finder del I, punkt 3, anvendelse.
0132	LGD uden MoC og tilsynsforanstaltninger		LGD'en uden MoC og tilsynsforanstaltninger er den LGD, der hverken inkluderer den MoC, der er tilføjet af instituttet i overensstemmelse med artikel 179, stk. 1, litra f), og artikel 181 i forordning (EU) nr. 575/2013, eller virkningen af foranstaltninger, der er indført af de kompetente myndigheder (multiplikatorer, tillæg, bundgrænser eller lignende foranstaltninger, der direkte øger LGD'en). For porteføljer, der svarer til en individuel klasse eller pulje, indberettes LGD'en for den klasse, der ekskluderer MoC'en og ekskluderer tilsynsforanstaltningerne. For porteføljer, der svarer til en aggregering af låntagere i forskellige klasser eller puljer, indberettes det EAD-vægtede gennemsnit af LGD'erne for de respektive eksponeringer, der ekskluderer MoC'erne og ekskluderer tilsynsforanstaltninger. LGD'en uden MoC og tilsynsforanstaltninger skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1. Hvis instituttet ikke er i stand til at isolere de relevante forsigtighedsjusteringer, finder del I, punkt 3, anvendelse.
0133	LGD uden MoC, tilsynsforanstaltninger og komponent for nedgangsperioden,		LGD'en uden MoC, tilsynsforanstaltninger og komponent for nedgangsperioden er den LGD, der hverken inkluderer den MoC, der er tilføjet af instituttet i overensstemmelse med artikel 179, stk. 1, litra f), og artikel 181 i forordning (EU) nr. 575/2013, eller virkningen af foranstaltninger, der er indført af de kompetente myndigheder (multiplikatorer, tillæg, bundgrænser eller lignende foranstaltninger, der direkte øger LGD'en), og ej heller komponenten for nedgangsperioden som påkrævet i nævnte forordnings artikel 181, stk. 1, litra b). For porteføljer, der svarer til en individuel klasse eller pulje, indberettes LGD'en for den klasse, der ekskluderer MoC'en, tilsynsforanstaltningerne og komponenten for nedgangperioden. For porteføljer, der svarer til en aggregering af låntagere i forskellige klasser eller puljer, indberettes det EAD-vægtede gennemsnit af LGD'erne for de respektive eksponeringer, der ekskluderer MoC'erne, tilsynsforanstaltninger og komponenten for nedgangsperioden.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			LGD'en uden MoC, tilsynsforanstaltninger og komponent for nedgangperioden skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1. Hvis instituttet ikke er i stand til at isolere de relevante forsigtighedsjusteringer, finder del I, punkt 3, anvendelse.
0140	Løbetid	Skema C08.01, kolonne 0250, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes den EAD-vægtede løbetid. Den udtrykkes i antal dage. Denne oplysning indberettes ikke for eksponeringer, for hvilke løbetid ikke er et element i beregningen af RWA. Løbetid indberettes navnlig ikke for porteføljer, der repræsenterer eksponeringer i eksponeringsklassen »Detail«.
0150	Forventet tab	Skema C08.01, kolonne 0280, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes det forventede tab.
0160	Hensættelser vedrørende misligholdte eksponeringer	Skema C09.02, kolonne 0050, 0055 og 0060, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes hensættelserne vedrørende misligholdte eksponeringer. Dette omfatter alle generelle og specifikke kreditrisikojusteringer for misligholdte eksponeringer som fastsat i artikel 110 i forordning (EU) nr. 575/2013. (Enkeltstående) kreditrisikojusteringer, som anvendes af et institut i forbindelse med ændringer i implementeringen af definitionen af misligholdelse, skal indberettes i overensstemmelse med det, der er registreret i instituttets database.
0170	RWA	Skema C08.01, kolonne 0260, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	RWA efter støttefaktorer (støttefaktorer for SMV'er og infrastruktur) indberettes. RWA omfatter ikke virkningen af mulige foranstaltninger i henhold til artikel 458 i forordning (EU) nr. 575/2013.
0180	RWA efter standardmetoden	Tredje del, afsnit II, kapitel 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	RWA efter standardmetoden er det hypotetiske RWA beregnet ved anvendelse af standardmetoden for kreditrisiko på eksponeringerne i stedet for IRB-metoden.

C 103 — Oplysninger om eksponeringer i porteføljer med høj misligholdelsesrisiko

For porteføljer, der er nævnt i bilag I, og som har en anden status for sikkerhedsstillelse end »ikke relevant«, kan følgende oplysninger udelades, når den godkendte model ikke tager højde for forskellige LGD-beregninger for sikrede og usikrede dele af en eksponering: LGD (kolonne 0130), LGD uden tilsynsforanstaltninger (kolonne 0131), LGD uden MoC og tilsynsforanstaltninger (kolonne 0132), LGD uden MoC, tilsynsforanstaltninger og komponent for nedgangsperioden (kolonne 0133), forventet tab (kolonne 0150), RWA (kolonne 0170), tabsprocent seneste år (kolonne 0210) og tabsprocent de seneste 5 år (kolonne 0220).

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Porteføljе-ID		Det porteføljе-ID, der i skema C 103, kolonne 0010, i bilag I definerer porteføljen, indberettes her. Dette ID er en ID-kode for rækken og skal være unik for hver enkelt række i skemaet. Henførelsen af eksponeringer til porteføljе-ID'er er ikke eksklusiv: Eksponeringer eller dele af eksponeringer skal indberettes under alle relevante porteføljе-ID'er.
0040	Antal låntagere		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0040, i bilag I finder anvendelse.
0060	PD		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0060, i bilag I finder anvendelse.
0061	PD uden tilsynsforanstaltninger		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0061, i bilag I finder anvendelse.
0062	PD uden MoC og tilsynsforanstaltninger		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0062, i bilag I finder anvendelse.
0080	Oprindelig eksponering før anvendelse af konverteringsfaktorer		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0080, i bilag I finder anvendelse.
0090	Eksponering efter substitutionsvirkninger af kreditrisikoreduktionsteknikker før anvendelse af konverteringsfaktorer		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0090, i bilag I finder anvendelse.
0100	Kreditkonverteringsfaktor		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0100, i bilag I finder anvendelse.
0110	Eksponering ved misligholdelse		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0110, i bilag I finder anvendelse.
0120	Værdi af sikkerhedsstillelse		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0120, i bilag I finder anvendelse.
0130	LGD		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0130, i bilag I finder anvendelse.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0131	LGD uden tilsynsforanstaltninger		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0131, i bilag I finder anvendelse.
0132	LGD uden MoC og tilsynsforanstaltninger		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0132, i bilag I finder anvendelse.
0133	LGD uden MoC, tilsynsforanstaltninger og komponent for nedgangsperioden		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0133, i bilag I finder anvendelse.
0140	Løbetid		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0140, i bilag I finder anvendelse.
0150	Forventet tab		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0150, i bilag I finder anvendelse.
0160	Hensættelser vedrørende misligholdte eksponeringer		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0160, i bilag I finder anvendelse.
0170	RWA		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0170, i bilag I finder anvendelse.
0180	RWA efter standardmetoden		Instrukserne for skema C 102, kolonne 0180, i bilag I finder anvendelse.
0190	Misligholdelsesrate seneste år		Her indberettes misligholdelsesraten for det seneste år. I den forbindelse defineres misligholdelsesraten som forholdet mellem følgende værdier: a) summen af de eksponeringer (oprindelig eksponering, kolonne 0080, målt på referencedatoen minus et år), der ikke var misligholdte præcis et år før referencedatoen, og som blev misligholdt mellem referencedatoen minus et år og referencedatoen b) summen af de eksponeringer (oprindelig eksponering, kolonne 0080, målt på referencedatoen minus et år), der ikke var misligholdte på referencedatoen minus et år. Nye eksponeringer, der blev genereret i året før referencedatoen, indberettes ikke. Eksponeringer, der blev misligholdt og genetableret i året før referencedatoen, medtages i både tælleren og nævneren. Flere misligholdelser fra samme låntager medtages kun én gang.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			Disse oplysninger indberettes kun for porteføljе-ID'er, der vedrører ikkemisligholdte eksponeringer, og skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1. Misligholdelser og misligholdelsesdatoer anvendes, som de blev registreret ved implementeringen af den definition af misligholdelse, der var gældende på tidspunktet for begivenheden, dvs. at instituttet skal anse misligholdelsen for at have fundet sted i forhold til den definition af misligholdelse, som blev anvendt af instituttet på det tidspunkt, hvor begivenheden blev registreret. Ændringer i definitionen af misligholdelse tages kun i betragtning fremadrettet fra tidspunktet for deres implementering, mens retrospektiv anvendelse af ændringer i definitionen af misligholdelse efter den pågældende misligholdelsesbegivenhed (bagudrettet simulering) ikke er tilladt.
0200	Misligholdelses-rate de seneste 5 år		Det vægtede gennemsnit af de misligholdelsesrater, der er konstateret i de seneste fem år før referencedatoen. Den i kolonne 0190 anførte definition af misligholdelsesrate anvendes. De vægte, der skal anvendes, er de ikkemisligholdte eksponeringer, der anvendes til at beregne misligholdelsesraten i overensstemmelse med kolonne 0190. Hvis instituttet ikke er forpligtet til at beregne en misligholdelsesrate for de seneste fem år før referencedatoen i henhold til artikel 180, stk. 1, litra h), eller artikel 180, stk. 2, litra e), i forordning (EU) nr. 575/2013, skal instituttet udarbejde en proxy ved anvendelse af dets længste historik op til fem år før referencedatoen og forelægge dokumentationen for beregningen for sin kompetente myndighed. Disse oplysninger indberettes kun for porteføljе-ID'er, der vedrører ikkemisligholdte eksponeringer, og skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1. Misligholdelser og misligholdelsesdatoer anvendes, som de blev registreret ved implementeringen af den definition af misligholdelse, der var gældende på tidspunktet for begivenheden, dvs. at instituttet skal anse misligholdelsen for at have fundet sted i forhold til den definition af misligholdelse, som blev anvendt af instituttet på det tidspunkt, hvor begivenheden blev registreret. Ændringer i definitionen af misligholdelse tages kun i betragtning fremadrettet fra tidspunktet for deres implementering, mens retrospektiv anvendelse af ændringer i definitionen af misligholdelse efter den pågældende misligholdelsesbegivenhed (bagudrettet simulering) ikke er tilladt.
0210	Tabsprocent seneste år		Tabsprocenten for det seneste år indberettes kun for porteføljе-ID'er, der vedrører »ikkemisligholdte« og »misligholdte« eksponeringer. For ikkemisligholdte porteføljer er tabsprocenten summen af kreditrisikojusteringer og afskrivninger, der er anvendt i året før referencedatoen, på eksponeringer, der ikke var misligholdte præcis et år før referencedatoen, og som blev misligholdt i året før referencedatoen, delt med summen af EAD, målt præcis et år før referencedatoen, af de eksponeringer, der ikke var misligholdte præcis et år før referencedatoen, og som blev misligholdt i året før referencedatoen.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			Tælleren for tabsprocenten skal omfatte alle kreditrisikojusteringer og afskrivninger, der vedrører de porteføljer, der var misligholdte i året før referencetidspunktet, herunder kreditrisikojusteringer anvendt før misligholdelsesdatoen. Nye eksponeringer, der blev genereret i året før referencedatoen, indberettes ikke. Eksponeringer, der blev misligholdt og genetableret i året før referencedatoen, medtages i nævneren for tabsprocenten, og kreditrisikojusteringerne og afskrivningerne for de pågældende eksponeringer indgår i tælleren for tabsprocenten. Flere misligholdelser fra samme låntager medtages kun én gang. For misligholdte porteføljer tages der i forbindelse med tabsprocenten højde for eksponeringer, som var misligholdte præcis et år før referencedatoen. Den skal være summen af: a) kreditrisikojusteringer for disse eksponeringer et år før referencedatoen og b) kreditrisikojusteringer og afskrivninger, der er anvendt i året før referencedatoen, delt med summen af EAD, målt præcis et år før referencedatoen, af de pågældende eksponeringer. Nye misligholdelser i året før referencedatoen indberettes ikke. Eksponeringer, der blev genetableret i året før referencedatoen, medtages i nævneren for tabsprocenten, og kreditrisikojusteringerne og afskrivningerne for de pågældende eksponeringer indgår i tælleren for tabsprocenten. Flere misligholdelser fra samme låntager medtages kun én gang. Tabsprocenten skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1. Misligholdelser og misligholdelsesdatoer anvendes, som de blev registreret ved implementeringen af den definition af misligholdelse, der var gældende på tidspunktet for begivenheden, dvs. at instituttet skal anse misligholdelsen for at have fundet sted i forhold til den definition af misligholdelse, som blev anvendt af instituttet på det tidspunkt, hvor begivenheden blev registreret. Ændringer i definitionen af misligholdelse tages kun i betragtning fremadrettet fra tidspunktet for deres implementering, mens retrospektiv anvendelse af ændringer i definitionen af misligholdelse efter den pågældende misligholdelsesbegivenhed (bagudrettet simulering) ikke er tilladt.
0220	Tabsprocent de seneste 5 år		Det EAD-vægtede gennemsnit af de tabsprocenter, der er konstateret i de seneste fem år før referencedatoen, indberettes kun for porteføljе-ID'er, der vedrører »ikkemisligholdte« og »misligholdte« eksponeringer. Den i kolonne 0210 anførte definition af tabsprocent anvendes. Tabsprocenten for de seneste fem år baseres på de seneste fem års årlige tabsprocenter, såfremt disse årlige tabsprocenter defineres analogt med definitionen af tabsprocenten i kolonne 0210, og de årlige tabsprocenter skal navnlig ikke omfatte yderligere ændringer i kreditrisikojusteringer og afskrivninger, som har fundet sted efter observationsperioden (kalenderåret) for hver årlig tabsprocent. Hvis instituttet ikke er forpligtet til at anvende data for de seneste fem år før referencedatoen i henhold til artikel 181, stk. 2, sidste afsnit, i forordning (EU) nr. 575/2013, skal instituttet udarbejde en proxy ved anvendelse af dets længste historik op til fem år før referencedatoen og forelægge dokumentationen for beregningen for sin kompetente myndighed. Tabsprocenten skal udtrykkes som en værdi mellem 0 og 1. Misligholdelser og misligholdelsesdatoer anvendes, som de blev registreret ved implementeringen af den definition af misligholdelse, der var gældende på tidspunktet for begivenheden, dvs. at instituttet skal anse misligholdelsen for at have fundet sted i forhold til den definition af misligholdelse, som blev anvendt af instituttet på det tidspunkt, hvor begivenheden blev registreret. Ændringer i definitionen af misligholdelse tages kun i betragtning fremadrettet fra tidspunktet for deres implementering, mens retrospektiv anvendelse af ændringer i definitionen af misligholdelse efter den pågældende misligholdelsesbegivenhed (bagudrettet simulering) ikke er tilladt.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0250	RWA-		Institutterne beregner og indberetter RWA- for porteføljer, der er omhandlet i bilag I, skema 103, med følgende porteføljе-ID'er: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA- er det hypotetiske RWA, efter anvendelse af støttefaktorer, der fremkommer efter anvendelse af værdierne for PD- i stedet for instituttets PD-værdier, for hver eksponering. De øvrige parametre, der er nødvendige med henblik på beregningen, ændres ikke. PD- baseres på en særskilt beregning for hver låntagerklasse. Låntagerklasserne som indberettet i kolonne 0005, skema C 08.02, i bilag I til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2021/451 skal anvendes (se instrukser i skema C 08.01, kolonne 0010, og skema C 08.02 i bilag II til nævnte forordning). For hver låntagerklasse er p^- den mindste positive værdi, der opfylder formlen $$p^- + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^- \cdot (1-p^-)}{n}} \geq DR_{1y}$$ where $DR_{1y} > 0$, og $p^- = 0$ hvor $DR_{1y} = 0$. Her. Φ^{-1} = den inverse funktion af den standardiserede (kumulerede) normalfordeling q = konfidensniveauet på 90 % DR_{1y} = den antalsvægtede misligholdelsesrate for året før referencedatoen, dvs. antallet af låntagere, der ikke misligholdte, og som var henført til den pågældende låntagerklasse præcis et år før referencedatoen, og som misligholdte i det seneste år, delt med antallet af låntagere, der ikke misligholdte, og som var henført til den pågældende låntagerklasse præcis et år før referencedatoen n = antallet af låntagere, der ikke misligholdte, og som var henført til den pågældende låntagerklasse præcis et år før referencedatoen. For hver låntager skal PD- være lig med p^-, hvor p^- beregnes i overensstemmelse med formlen i fjerde underafsnit for låntagerens låntagerklasse.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0260	RWA+		Institutterne beregner og indberetter RWA+ for porteføljer, der er omhandlet i bilag I, skema 103, med følgende porteføljе-ID: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA+ er det hypotetiske RWA, efter støttefaktorer, der fremkommer efter anvendelse af værdierne for PD+ i stedet for instituttets PD-værdier, for hver eksponering. De øvrige parametre, der er nødvendige med henblik på beregningen, ændres ikke. PD+ baseres på en særskilt beregning for hver låntagerklasse. Låntagerklasserne som indberettet i kolonne 0005, skema C 08.02, i bilag I til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2021/451 skal anvendes (se instrukser i skema C 08.01, kolonne 0010, og skema C 08.02 i bilag II til nævnte forordning). For hver låntagerklasse er p^+ den største positive værdi, der opfylder formlen $$p^+ - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^+ \bullet (1-p^+)}{n}} \leq DR_{1y}$$ I denne ligning gælder følgende: Φ^{-1} = den inverse funktion af den standardiserede (kumulerede) normalfordeling q = konfidensniveauet på 90 % DR_{1y} = den antalsvægtede misligholdelsesrate for året før referencedatoen, dvs. antallet af låntagere, der ikke misligholdte, og som var henført til den pågældende låntagerklasse præcis et år før referencedatoen, og som misligholdte i det seneste år, delt med antallet af låntagere, der ikke misligholdte, og som var henført til den pågældende låntagerklasse præcis et år før referencedatoen n = antallet af låntagere, der ikke misligholdte, og som var henført til den pågældende låntagerklasse præcis et år før referencedatoen. For hver låntager skal PD+ være lig med p^+, hvor p^+ beregnes i overensstemmelse med formlen i fjerde underafsnit for låntagerens låntagerklasse.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0270	RWA–		Institutterne beregner og indberetter RWA—for porteføljer, der er omhandlet i bilag I, skema 103, med følgende porteføljeidentifikator (ID): CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA– er det hypotetiske RWA, efter støttefaktorer, der fremkommer efter anvendelse af værdierne for PD-- i stedet for instituttets PD-værdier, for hver eksponering. De øvrige parametre, der er nødvendige med henblik på beregningen, ændres ikke. PD-- baseres på en særskilt beregning for hver låntagerklasse. Låntagerklasserne som indberettet i kolonne 0005, skema C 08.02, i bilag I til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2021/451 skal anvendes (se instrukser i skema C 08.01, kolonne 0010, og skema C 08.02 i bilag II til nævnte forordning). For hver låntagerklasse er p^{--} den mindste positive værdi, der opfylder formlen $$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{--} \cdot (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$ where $DR_{5y} > 0$, og $p^{--} := 0$ hvor $DR_{5y} = 0$ Her. Φ^{-1} = den inverse funktion af den standardiserede (kumulerede) normalfordeling q = konfidensniveauet på 90 % DR_{5y} = misligholdelsesraten for de seneste 5 år for låntagerklassen, beregnet som det simple gennemsnit for fem etårige antalsvægtede misligholdelsesrater n = antallet af låntagere, der ikke misligholdte, og som var henført til den pågældende låntagerklasse præcis et år før referencedatoen. For hver låntager skal PD-- være lig med p^{--}, hvor p^{--} beregnes i overensstemmelse med formlen i fjerde underafsnit for låntagerens låntagerklasse.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0280	RWA++		Institutterne beregner og indberetter RWA++ for porteføljer, der er omhandlet i bilag I, skema 103, med følgende porteføljе-ID: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA++ er det hypotetiske RWA, efter støttefaktorer, der fremkommer efter anvendelse af værdierne for PD++ i stedet for instituttets PD-værdier, for hver eksponering. De øvrige parametre, der er nødvendige med henblik på beregningen, ændres ikke. PD++ baseres på en særskilt beregning for hver låntagerklasse. Låntagerklasserne som indberettet i kolonne 0005, skema C 08.02, i bilag I til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2021/451 skal anvendes (se instrukser i skema C 08.01, kolonne 0010, og skema C 08.02 i bilag II til nævnte forordning). For hver låntagerklasse er p^{++} den største positive værdi, der opfylder formlen $$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{++} \bullet (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$ hvor Φ^{-1} = den inverse funktion af den standardiserede (kumulerede) normalfordeling q = konfidensniveauet på 90 % DR_{5y} = misligholdelsesraten for de seneste 5 år for låntagerklassen, beregnet som det simple gennemsnit for fem etårige antalsvægtede misligholdelsesrater n = antallet af låntagere, der ikke misligholdte, og som var henført til den pågældende låntagerklasse præcis et år før referencedatoen. For hver låntager skal PD++ være lig med p^{++}, hvor p^{++} beregnes i overensstemmelse med formlen i fjerde underafsnit for låntagerens låntagerklasse.

C 105.01 —Definition af interne modeller

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	ID for intern model		Instituttet skal indberette det ID for den interne model, som den kompetente myndighed har tildelt. Hvis et sådant ikke er tildelt, skal instituttet indberette det ID for den interne model, som det selv har tildelt. ID'et for den interne model skal entydigt henvise til en intern model, der er godkendt af den kompetente myndighed, og som anvendes til beregningen af RWA. Det er en ID-kode for rækken og skal være unik for hver enkelt række i skemaet.
0020	Modellens betegnelse		Her indberettes den betegnelse for den interne model, som det indberettende institut har tildelt.
0030	Risikoparameter efter IRB-metoden		Risikoparametret efter IRB-metoden er en af følgende: a) PD b) LGD c) CCF. For en intern model for »selskaber — eksponeringer relateret til specialiseret långivning« i henhold til artikel 153, stk. 5, i forordning (EU) nr. 575/2013 (»Kategoriseringskriterier for specialiseret långivning«) skal feltet enten stå tomt eller udfyldes med angivelsen »NULL«.
0040	Eksponering ved misligholdelse	Skema C08.01, kolonne 0110, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes den samlede eksponeringsværdi af de eksponeringer, der behandles med den specifikke model.
0050	EAD-vægtet gennemsnitlig misligholdelsesrate anvendt ved kalibrering		Det EAD-vægtede gennemsnit af de årlige misligholdelsesrater, når disse anvendes ved kalibreringen af PD-modellerne. Denne oplysning udfyldes kun for PD-modeller. De data, der anvendes i kalibreringen af modelparametrene, anvendes her. Hvis der ikke findes interne data, og kalibreringen er baseret på eksterne data, indberettes de eksterne data.
0060	Antalsvægtet gennemsnitlig misligholdelsesrate anvendt ved kalibrering		Det simple gennemsnit af de årlige antalsvægtede misligholdelsesrater, der anvendes ved kalibreringen af PD-modellerne, indberettes. Denne oplysning udfyldes kun for PD-modeller. De data, der anvendes i kalibreringen af modelparametrene, anvendes her. Hvis der ikke findes interne data, og kalibreringen er baseret på eksterne data, indberettes de eksterne data.
0070	Langsigtet PD		Det positionsmål, som instituttet anvender ved kalibreringen af modellerne, som omfatter eventuelle forsigtighedsjusteringer af det antalsvægtede gennemsnit af de årlige misligholdelsesrater, der anvendes ved kalibreringen af PD-modellerne. Denne oplysning udfyldes kun for PD-modeller.
0080	Genetableringsprocent (»cure rate«) for misligholdte aktiver		Genetableringsprocenten for misligholdte aktiver er den procentdel af misligholdte udeståender, der igen bliver »ikkemisligholdte«, over en 12-månedersperiode. Et institut, der ikke beregner genetableringsprocenter for en given model, skal beregne en proxy for genetableringsprocenter, i overensstemmelse med den fastlagte definition. Instituttet skal meddele den kompetente myndighed, at det anvender en proxy. Denne oplysning udfyldes kun for LGD-modeller.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0090	Inddrivelsesrate, ikkegenetablerede misligholdelser, overtagne aktiver		Den antalsvægtede gennemsnitlige inddrivelsesrate vedrørende ikkegenetablerede misligholdelser, der indgår i den tidsserie, instituttet anvender ved kalibreringen af LGD-modellerne vedrørende ikkemisligholdte aktiver. De data, der anvendes i kalibreringen af modelparametrene, anvendes her. Hvis der ikke findes interne data, og kalibreringen er baseret på eksterne data, indberettes de eksterne data. Et institut, der ikke har en specifik inddrivelsesrate for ikkegenetablerede misligholdelser på grund af en ufuldstændig inddrivelsesprocedure, skal beregne en proxy under hensyntagen til konstaterede inddrivelser samt estimater for inddrivelser for ufuldstændig gældsomlægning. Instituttet skal meddele den kompetente myndighed, at det anvender en proxy. Denne oplysning udfyldes kun for LGD-modeller.
0100	Inddrivelsesperiode, ikkegenetablerede misligholdelser, overtagne aktiver		Den antalsvægtede gennemsnitlige varighed af inddrivelsesperioden (fra misligholdelsens begyndelse til afslutningsdatoen for inddrivelsesprocedurerne) for de ikkegenetablerede misligholdelser, der indgår i den tidsserie, instituttet anvender ved kalibreringen af LGD-modellerne vedrørende ikkemisligholdte aktiver. Den antalsvægtede gennemsnitlige længde udtrykkes i antal dage. De data, der anvendes i kalibreringen af modelparametrene, anvendes her. Hvis der ikke findes interne data, og kalibreringen er baseret på eksterne data, indberettes de eksterne data. Et institut, der ikke har en specifik længde for inddrivelsesperioder for ikkegenetablerede misligholdelser på grund af en ufuldstændig inddrivelsesprocedure, skal beregne en proxy under hensyntagen til den fastlagte definition. Instituttet skal meddele den kompetente myndighed, at det anvender en proxy. Denne oplysning udfyldes kun for LGD-modeller.
0110	Fælles afgørelse	Artikel 20, stk. 2, litra a), i forordning (EU) nr. 575/2013	Instituttet skal indberette, om der foreligger en fælles afgørelse om tilsynsmæssige krav mellem den konsoliderende og den anden kompetente værtsmyndighed vedrørende tilladelsen til at anvende IRB-metoden til at beregne de tilsynsmæssige krav for de eksponeringer, der besiddes af institutternes datterselskaber i de indberettede benchmarkporteføljer.
0120	Konsoliderende tilsynsmyndighed	Artikel 20 i forordning (EU) nr. 575/2013	ISO-koden for oprindelseslandet for den kompetente myndighed, der er ansvarlig for det konsoliderede tilsyn med det institut, der anvender en IRB-metode.
0130	RWA	Skema C08.01, kolonne 0260, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes samlet RWA efter støttefaktorer (støttefaktorer for SMV'er og infrastruktur) af de eksponeringer, der behandles med denne ratingmodel.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0140	RWA-tillæg		RWA-tillæggene skal være en underposition (»hvoraf«) af RWA (skema C105.01, kolonne 0130) og skal omfatte følgende: a) RWA, der lægges til det RWA, der følger af anvendelsen af modellens risikoparametre, såfremt eventuelle yderligere interne forsigtighedsforanstaltninger anvendes direkte på RWA'et b) RWA, der lægges til det RWA, der følger af anvendelsen af modellens risikoparametre, såfremt eventuelle tilsynsforanstaltninger anvendes direkte på RWA'et. Beløbene under litra a) og b) omfatter ikke foranstaltninger, der allerede er afspejlet i PD (skema C102, kolonne 0060, og skema C103, kolonne 0060), kreditkonverteringsfaktorer (kolonne 0100 i skema C102 og C103) eller LGD (skema C102 og C103, kolonne 0130), men skal begrænses til foranstaltninger, der anvendes direkte på RWA, og, hvis det er relevant, ud over de forsigtighedsmargener og tilsynsforanstaltninger (multiplikatorer, tillæg, bundgrænser eller lignende foranstaltninger,), der øger risikoparametrene. RWA-tillæggene omfatter ikke virkningen af mulige foranstaltninger i henhold til artikel 458 i forordning (EU) nr. 575/2013. Hvis instituttet ikke er i stand til at isolere de relevante forsigtighedsjusteringer, finder del I, punkt 3, anvendelse.

C 105.02 — Kobling mellem interne modeller og porteføljer

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Porteføljе-ID	Skema C102, kolonne 0010, og skema C103, kolonne 0010	Her indberettes det porteføljе-ID, der entydigt identificerer porteføljen i overensstemmelse med skema C102 og C103 i bilag I. Kolonne 0010 og 0020 er en sammensat ID-kode for rækken og skal være unik for hver enkelt række i dette skema.
0020	ID for intern model	Skema C 105.01, kolonne 0010	Her indberettes det ID for den interne model, som det indberettende institut har tildelt. Kolonne 0010 og 0020 er en sammensat ID-kode for rækken og skal være unik for hver enkelt række i skema C105.02.
0030	Eksponering ved misligholdelse	Skema C08.01, kolonne 0110, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes den samlede eksponeringsværdi af de eksponeringer, der indgår i den porteføljе, der er defineret i kolonne 0010, og behandles med den ratingmodel, der er defineret i kolonne 0020. Hvis alle eksponeringer i en given porteføljе behandles med den samme specifikke model, er eksponeringsværdien lig med den værdi, der er indberettet for den samme porteføljе i kolonne 0110 i skema C 102 eller C 103, alt efter hvad der er relevant.
0040	RWA	Skema C08.01, kolonne 0260, i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2021/451	Her indberettes det samlede RWA efter støttefaktorer for de eksponeringer, der indgår i den porteføljе, der er defineret i kolonne 0010, og behandles med den ratingmodel, der er defineret i kolonne 0020. Hvis alle eksponeringer i en given porteføljе behandles med den samme specifikke model, er RWA lig med den værdi, der er indberettet for den samme porteføljе i kolonne 0170 i skema C 102 eller C 103, alt efter hvad der er relevant.

C 105.03 — Kobling mellem interne modeller og lande

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0005	Række-ID		Koden er en ID-kode for rækken og skal være unik for hver enkelt række i skemaet. Den skal være i nummerorden (1, 2, 3 osv.).
0010	ID for intern model	Skema C105.01, kolonne 0010	Her indberettes det ID for den interne model, som det indberettende institut har tildelt. Når et ID for intern model er knyttet til flere lande, skal der indberettes separate rækker for hver kombination af »ID for intern model« og »Instituttets placering«. Kolonne 0010 og 0020 er en sammensat id-kode for rækken og kombinationen af dem skal være unik for hver enkelt række i tabellen.
0020	Instituttets placering	Artikel 20 i forordning (EU) nr. 575/2013	ISO-koden for det registrerede hjemsted for hvert datterselskab, hvor de IRB-eksponeringer, der indberettes for hver benchmarkportefølje er bogført, uanset om der foreligger en tilladelse fra værtstilsynsmyndigheden til anvendelse af en IRB-metode.«

BILAG II

»*BILAG V*

BENCHMARKINSTRUMENTER OG PORTEFØLJER. MARKEDSRISIKO

Afsnit 1: Instrukser

Afsnit 2: Instrumenter

Afsnit 3: Individuelle porteføljer — Enkelt instrument

Afsnit 4: Individuelle porteføljer — Flere instrumenter

Afsnit 5: Aggregerede porteføljer

Afsnit 6: Yderligere specifikationer for instrumenter

Afsnit 7: Valideringsporteføljer for SBM

Afsnit 1: Instrukser

a) I dette bilag forstås ved:

i) »dato for opførelsen i handelsbeholdningen«: datoen og tidspunktet for institutternes opførelse af transaktionerne i handelsbeholdningen med henblik på benchmarkingen

ii) »indledende markedsvurdering (IMV)«: marked-to-market-værdien af de instrumenter, der er omhandlet i dette bilags afsnit 2, på IMV-referencedatoen og -tidspunktet

iii) »IMV-referencedato«: den dato og det tidspunkt, der skal anvendes som reference af institutterne ved fastsættelsen af IMV for transaktionerne i benchmarkporteføljen

iv) »IMV-indgivelsesdato«: den dato, hvor institutterne skal indberette resultaterne af IMV for transaktionerne i benchmarkporteføljen

v) »VaR«: value-at-risk

vi) »sVaR«: value-at-risk i stresssituationer

vii) »IRC«: forøget misligholdelses- og migreringsrisiko

viii) »CTP«: korrelationshandelsporteføljen

ix) »APR«: alle prisrisici beregnet i overensstemmelse med artikel 377, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013

x) »risikomålinger«: værdien af VaR, sVaR og, når det kræves, IRC og APR for porteføljerne, jf. dette bilags afsnit 3, 4 og 5, mellem den indledende og den endelige referencedato for risikomålinger

xi) »indledende referencedato for risikomålinger«: den dato, hvor institutterne skal begynde at beregne værdierne for risikomålinger

xii) »endelig referencedato for risikomålinger«: den dato, hvor institutterne skal være færdige med at beregne værdierne for risikomålinger

xiii) »indgivelsesdato for risikomålinger«: den dato, hvor institutterne skal indberette resultaterne af risikomålingerne for transaktionerne i benchmarkporteføljen

xiv) »nutidsværdi (PV)«: marked-to-market-værdien af de porteføljer, der er omhandlet i dette bilags afsnit 3, på den endelige referencedato for risikomålinger

xv) »ATM«: »at the money« for så vidt angår forholdet mellem den aktuelle eller fremtidige pris for et derivats underliggende aktiv og derivatets strikekurs

xvi) »OTM«: »out of the money« for så vidt angår forholdet mellem den aktuelle eller fremtidige pris for et derivats underliggende aktiv og derivatets strikekurs

xvii) »ITM«: »in the money« for så vidt angår forholdet mellem den aktuelle eller fremtidige pris for et derivats underliggende aktiv og derivatets strikekurs

xviii) »lang«: »købt«, og »kort«: »solgt«

xix) »CDS«: credit default swaps;

xx) for CDS betyder »lang« »købt beskyttelse«, og »kort« betyder »solgt beskyttelse«

xxi) »MIO.«: millioner

xxii) »OTC«: over-the-counter

xxiii) »ASA«: alternativ standardmetode som omhandlet i tredje del, afsnit IV, kapitel 1a, afdeling 1, i forordning (EU) nr. 575/2013.

xxiv) »SBM«: følsomhedsmetoden som omhandlet i tredje del, afsnit IV, kapitel 1a, afdeling 2, i forordning (EU) nr. 575/2013

xxv) »DRC«: kravet vedrørende misligholdelsesrisiko som omhandlet i tredje del, afsnit IV, kapitel 1a, afdeling 5, i forordning (EU) nr. 575/2013.

xxvi) »RRAO«: tillæg for restrisici som omhandlet i tredje del, afsnit IV, kapitel 1a, afdeling 4, i forordning (EU) nr. 575/2013.

b) Følgende datoer anvendes for »benchmarkingen«:

i) Datoen for opførelsen i handelsbeholdningen er den 30. januar 2025.

ii) IMV-referencedatoen (og den indledende SBM) er den 6. februar 2025 (kl. 17.30 CET).

iii) IMV-indgivelsesdatoen (og den indledende SBM og SBM-valideringen) er den 28. februar 2025.

iv) Den indledende referencedato for risikomålinger er den 2. juni 2025.

v) Den endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA) er den 13. juni 2025.

vi) Indgivelsesdatoen for risikomålinger (og for ASA) er den 18. juli 2025.

c) Medmindre andet udtrykkeligt er anført i dette bilags afsnit 2, opføres alle positioner i handelsbeholdningen på den dato for opførelsen i handelsbeholdningen, der er omhandlet i litra b), nr. i), i dette afsnit. Når positionerne er blevet opført i handelsbeholdningen, skal hver portefølje blive stående, så længe benchmarkingen foregår, og beregnes ud fra den antagelse, at instituttet ikke foretager sig noget for at forvalte porteføljen på nogen måde i løbet af hele benchmarkingen. Medmindre andet udtrykkeligt er anført i specifikationerne for et bestemt instrument, skal strikekurserne for optionspositioner bestemmes i forhold til kurserne for det underliggende aktiv som konstateret ved handelsdagens afslutning på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

d) Med henblik på den indledende markedsvurdering skal værdiansættelsen af hvert instrument indsendes til instituttets kompetente myndighed senest på IMV-indgivelsesdatoen. Senest på denne dato indgiver instituttet en forklarende note, der ledsager resultaterne, i overensstemmelse med litra e). IMV oplyses i overensstemmelse med instituttets front office-værdiansættelse, hvis det er muligt. Hvis IMV'erne ikke leveres af instituttets front office, skal instituttet i den forklarende note angive, hvem der er kilden til IMV-dataene.

e) Den forklarende note, som institutterne skal indgive sammen med IMV'en, skal indeholde oplysninger om følgende for hvert instrument:

i) de risikofaktorer, der er anvendt til at beregne instrumentets IMV

ii) den værdiansættelsesmodel, der er anvendt til at beregne instrumentets IMV, og en beskrivelse af denne værdiansættelsesmodel

iii) de risikofaktorer, der indgår i VaR-modellen for instrumentet

iv) de risikofaktorer, der indgår i VaR-modellen, og som også er værdiansættelsesinput for instrumentets IMV

v) VaR-modellens specifikke karakteristika i forhold til instrumentet

vi) tilgængelige referencedata for instrumentet i instituttets eget format

vii) de aspekter, der er omhandlet i dette afsnits litra h), i), k), m), n), o), v), w), y), gg) og kk).

f) Med henblik på litra e), nr. v) skal følgende indgå i indberetningen:

i) kortfattede beskrivelser af VaR-modellerne

ii) anvendte metoder til fornyet værdiansættelse

iii) funktionel form, der er anvendt til at modelberegne afkast (f.eks. absolutte tal, relative tal, andre metoder)

iv) kvalitative oplysninger om de tidsserier, der anvendes til kalibrering af VaR-modellen i forhold til instrumentet (f.eks. kilde, metode til normalisering, anvendte undergrupper, andre oplysninger, som institutterne finder relevante for redegørelsen for de fremlagte resultater).

g) Den forklarende note, der er omhandlet i litra d), skal ajourføres, hver gang der foretages fornyet indberetning af enhver værdi, således at ændringerne afspejles i forhold til den foregående indberetning. Den forklarende note skal indeholde et afsnit, der opregner alle indberetningsdatoer og årsagerne til fornyet indberetning.

h) Risiciene ved positionerne skal beregnes uden hensyntagen til finansieringsomkostningerne. Hvor det er relevant, skal institutterne anvende dag-til-dag-renten for instrumentets valuta som diskonteringssatsen. Aftaler om sikkerhedsstillelse anses for at være indgået for de derivatinstrumenter, der er omhandlet i dette bilags afsnit 2. Hvis dette ikke er muligt, redegøres der i den forklarende note, der er omhandlet i litra d), for årsagerne hertil.

i) Modpartsrisiko og kreditværdijusteringsrisiko (CVA) tages ikke i betragtning ved værdiansættelsen af risiciene ved porteføljerne. Hvis dette ikke er muligt, redegøres der i den forklarende note, der er omhandlet i dette afsnits litra d), for årsagerne hertil. Institutterne skal indberette tilfælde, hvor andre typologier af værdiansættelsesjusteringer indgår i IMV, og for hvert finansielt instrument redegøre for metoden og virkningen i den forklarende note, der er omhandlet i dette afsnits litra d).

j) For transaktioner, der omfatter lange positioner i CDS'er, antager institutterne, at der betales et umiddelbart forudbetalt gebyr for at indtræde i positionen i overensstemmelse med markedsstandarderne og -konventionerne. Forfaldsdatoen for alle CDS'er skal svare til konventionelle kvartalsvise udløbsdatoer.

k) Yderligere specifikationer, der er nødvendige for at kunne foretage de prisberegninger, der kræves for CDS-positioner, skal være i overensstemmelse med almindeligt anvendte markedsstandarder og -konventioner, og der redegøres for disse specifikationer i den forklarende note, der er omhandlet i dette afsnits litra d).

l) Udløbsdatoen skal sikre, at transaktionen er tættest på den specificerede løbetid i overensstemmelse med markedsstandarder og -konventioner.

m) Med hensyn til oplysningerne om instrumenter, der ikke er omhandlet i dette bilags afsnit 2, skal institutterne fremlægge de antagelser, der er blevet anvendt, herunder konventionen for optælling af dage og valget af et omsætteligt og likvidt instrument, hvor det er tilladt, sammen med resultaterne i den forklarende note, der er omhandlet i dette afsnits litra d).

n) Institutter, der finder yderligere antagelser ud over dem, der er anført i dette afsnit, relevante for fortolkningen af resultaterne af deres benchmarking, herunder lukketid, coupon rolls, kobling til indekser osv., indgiver en beskrivelse af disse antagelser i den forklarende note, der er omhandlet i dette afsnits litra d).

o) I den forklarende note, der er omhandlet i dette afsnits litra d), redegøres for risici, der ikke er opfanget af modellen for de instrumenter, der er omhandlet i dette bilags afsnit 2.

p) Alle optioner behandles, som om de handles OTC, medmindre andet udtrykkeligt er anført.

q) De sædvanlige tidskonventioner for OTC-optioner følges. Løbetiden for en n-månedersoption er i n måneder. Hvis optionerne udløber på en dag, der ikke er en arbejdsdag, skal institutterne justere udløbsdatoen, således at den svarer til en arbejdsdag, i overensstemmelse med markedsstandarder og -konventioner.

r) Alle OTC-optioner behandles som følger:

   i) som amerikanske for single name-aktier og -råvarer

   ii) som europæiske for aktieindeks, valutaoptioner og swaptioner.

s) Alle OTC-optioner betragtes som »nøgne«, således at præmien ikke medtages i den indledende markedsvurdering.

t) Hvad angår CTP'er, skal institutter, der har tilladelse til at anvende APR-modellen for CTP'er, afgive oplysninger om deres mest relevante antagelser og markedsstandarder og -konventioner vedrørende de CTP-instrumenter, der er omhandlet i dette bilags afsnit 2, herunder de sikringsforhold, de har beregnet for at gøre CTP-instrumenterne CS01-neutrale på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

u) IMV for hvert instrument udtrykkes i EBA-instrumentets valuta, som er angivet i dette bilags afsnit 2 for det pågældende instrument.

v) For porteføljer, der består af et eller flere instrumenter denomineret i EBA-instrumentvalutaer, som er forskellige fra EBA's porteføljevaluta, omregnes resultatet til den indberettede EBA-porteføljevaluta ved hjælp af ECB-valutaspotkursen på den relevante dato. I den forklarende note, der er omhandlet i dette afsnits litra d), redegøres for det konverterede resultat.

w) Ved opførelse af positioner i handelsbeholdningen følge institutterne relevante markedskonventioner, medmindre andet er angivet i disse instrukser i beskrivelserne af instrumenterne (dette bilags afsnit 2).

x) Når et instrument eller det underliggende instrument for et derivat er genstand for en selskabshændelse, der påvirker benchmarkingen, som f.eks. et call fra udstederen, en misligholdelse eller lignende hændelser, skal institutterne udelade et sådant instrument fra benchmarkingen sammen med eventuelt tilknyttede CDS'er eller optioner.

y) For så vidt angår en indeksserie, henviser »on-the-run« til den mest likvide og omsættelige serie i dette indeks, som findes på markedet. Institutterne redegør for deres valg af »on-the-run«-serier sammen med de tilknyttede resultater i den ledsagende forklarende note, der er omhandlet i litra d) i dette afsnit.

z) Hvis ikke andet er angivet, anvender institutterne EU's benchmarkforordning for renten med henblik på at opføre de instrumenter, der er angivet i dette bilags afsnit 2. Institutterne angiver den anvendte sats, bortset fra dem, der er angivet i dette bilags afsnit 2, i den ledsagende forklarende note, der er omhandlet i litra d) i disse instrukser.

æ) Risikomålinger for de porteføljer, der er omhandlet i afsnit 3, 4 og 5, beregnes sammen med nutidsværdien fra »den indledende referencedato for risikomålinger« til »den endelige referencedato for risikomålinger«. FRTB ASA-risikomålinger (SBM, DRC og RRAC) beregnes for den »endelige referencedato for risikomålinger«. Institutterne indberetter resultaterne af disse beregninger til deres kompetente myndighed senest på indgivelsesdatoen for risikomålinger. IMV og SBM indberettes for hvert instrument. Risikomålinger, SBM, DRC, RRAO og nutidsværdi indberettes, hvis det er relevant, for hver portefølje, både individuelle og aggregerede. SBM, DRC og RRAO indberettes, hvis det er relevant, som minimum for de samme porteføljer, for hvilke der indberettes risikomålinger.

ø) For de porteføljer, der er omhandlet i afdeling 7, skal institutterne indberette SBM-resultater og indberette dem i overensstemmelse med indberetningsdatoerne for IMV-indberetningen.

å) Kun institutter, der har fået tilladelse til at modelberegne specifikke risici forbundet med gældsinstrumenter, skal indberette kreditspændsporteføljer. For så vidt angår renteporteføljer, som omfatter risici som en del af visse instrumenter, skal individuelle og aggregerede porteføljer modelberegnes af de institutter, der har fået tilladelse til at modelberegne den generelle renterisiko, og af de institutter, der har fået tilladelse til at modelberegne den generelle og den specifikke renterisiko.

aa) Resultaterne for både individuelle og aggregerede porteføljer indberettes kun, hvis resultaterne for de instrumenter, der indgår heri, også indberettes.

bb) I dette bilags afsnit 2 (Instrumenter) forstås ved »år T« »2025«, og ved »år T + X« forstås »2025 + X«, med X som angivet i afsnit 2.

cc) I dette bilags afsnit 2 (Instrumenter) fastsætter institutterne udløbsdatoen/forfaldsdatoen i overensstemmelse med følgende instrukser:

i) Hvis datoen er angivet, anvendes denne specifikke dato.

ii) Hvis der ikke er angivet nogen dato, anvendes markedskonventionen, hvis en sådan foreligger. Hvis der f.eks. er en markedskonvention om, at udløbs-/forfaldsdatoen er den tredje fredag i måneden, forstås ved »juni år T« den tredje fredag i måneden i år T.

iii) Hvis der ved månedens udgang står angivet »ved afslutningen«, forstås det som den sidste kalenderdag i måneden.

iv) Hvis en bestemt periode efter »datoen for opførelsen i handelsbeholdningen« er defineret som et antal dage, skal det forstås som den sidste dag i perioden. Hvis perioden er fastsat i uger, måneder eller år, er det den samme dag i den følgende uge eller måned eller det følgende år hvad angår datoen for opførelsen i handelsbeholdningen eller, hvis den sidste måned eller det sidste år i perioden er kortere, er det den sidste dag i den pågældende måned eller det pågældende år. Hvis »datoen for opførelsen i handelsbeholdningen + x periode« er en fredag, vælges den følgende arbejdsdag.

v) Medmindre andet er angivet, anvendes følgende antagelser: Konventionen for optælling af dage: Faktisk antal dage/360, feriekalender: Target2.

dd) I dette bilags afsnit 2 (Instrumenter) gælder følgende krav for alle CDS'er, medmindre andet udtrykkeligt er anført:

i) Kuponfrekvens: kvartalsvis

ii) Kupon (basispoint): 100

iii) Optælling af dage: Faktisk antal dage/360

iv) ISDA-definitioner år: 2014

v) Omstruktureringsklausul: Modified-Modified Restructuring (MMR)

vi) Løbetid: december år T+4

vii) Gældstype: ikkeefterstillet

viii) Løbetid: 5 år

ix) Startdato på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen

x) Den anvendte diskonteringskurve og inddrivelsesrate angives i den forklarende note, der er omhandlet i dette bilags litra d).

ee) IMV for obligationsinstrumenter omfatter påløbne renter.

ff) Institutterne indgiver oplysningerne om tidspunktet for værdiansættelsen af PV ved at angive tidspunktet i den forklarende note, der er omhandlet i dette afsnits litra d). Hvis det er muligt, beregnes værdiansættelsen af PV ved bankdagens afslutning.

gg) Porteføljernes risikoforanstaltninger beregnes i den samme valuta som porteføljevalutaen, eksklusive eventuelle valutarisici, som også er tilknyttet institutternes indberetningsvaluta. Valutarisikoen tages kun i betragtning, hvis den er uløseligt forbundet med instrumenterne. Hvis både resultaterne udtrykt i indberetnings- og porteføljevaluta indberettes som en del af benchmarkingen, omregnes med henblik på ASA-tal resultater beregnet i instituttets indberetningsvaluta til EBA's porteføljevaluta, idet der anvendes omregning til valutaspotkurs ved hjælp af den ECB-valutaspotkurs, der er knyttet til beregningsdatoen. Omregningen til EBA's porteføljevaluta indebærer ikke en ændring i valutarisikofaktorerne.

hh) Hvis artikel 325q, stk. 7, i forordning (EU) nr. 575/2013 (»metoden med basisvaluta«) finder anvendelse, skal institutterne, når de foretager SBM-beregninger og indberetter SBM-følsomheder, tage hensyn til de valutarisikofaktorer, der følger af anvendelsen af metoden med basisvaluta. De indberettede værdier skal ikke udtrykkes i den valgte basisvaluta, men i institutternes indberetningsvaluta, idet der anvendes omregning til valutaspotkurs ved hjælp af den ECB-valutaspotkurs, der er knyttet til den relevante dato.

Afsnit 2: Instrumenter

Institutterne oplyser i overensstemmelse med instrukserne i dette bilags afsnit 1 IMV for følgende finansielle instrumenter, hvor institutterne angiver risikomålinger og nutidsværdien af de porteføljer, der er angivet i afsnit 3 og 4:

AKTIER

101. Lang position i futures, EUROSTOXX 50-indekset (ticker: FESX).

Notionel værdi: svarende til værdien af indekset gange 1 000 EUR

Børs: Eurex

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

102. Lang position i 10 000 aktier, BAYER (ticker: BAYN GR).

Børs: Xetra

EBA's instrumentvaluta: EUR

103. Kort position i futures, BAYER (ticker: BAYN GR).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Børs: Eurex

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

104. Kort position i futures, STELLANTIS (ticker: STLA FP).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Børs: Euronext

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

105. Kort position i futures, ALLIANZ (ticker: ALV GR).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Børs: Eurex

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

106. Kort position i futures, BARCLAYS (ticker: BARC LN).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Børs: Eurex

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: GBP

107. Kort position i futures, DEUTSCHE BANK (ticker: DBK GR).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Børs: Eurex

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

108. Kort position i futures, CRÉDIT AGRICOLE (ticker: ACA FP).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Børs: Euronext

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

109. Lang position i call-optioner. Underliggende instrument, BAYER (ticker: BAYN GR), ATM (1 kontrakt = 100 aktier).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

110. Kort position i call-optioner. Underliggende instrument, BAYER (ticker: BAYN GR), ATM (1 kontrakt = 100 aktier).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Udløbsdato: december år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

111. Lang position i call-optioner. Underliggende instrument, PFIZER (ticker PFE US), 10 % OTM, (1 kontrakt = 100 aktier).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: USD

112. Lang position i put-optioner. Underliggende instrument, PFIZER (ticker PFE US), 10 % OTM, (1 kontrakt = 100 aktier).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: USD

113. Lang position i call-optioner. Underliggende instrument, BAYER (ticker: BAYN GR), 10 % OTM (1 kontrakt = 100 aktier).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Udløbsdato: december år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

114. Kort position i call-optioner. Underliggende instrument, BAYER (ticker: BAYN GR), 10 % OTM (1 kontrakt = 100 aktier).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

115. Lang position i call-optioner. Underliggende instrument, AVIVA (ticker: AV/LN), 10 % OTM (1 kontrakt = 100 aktier).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Udløbsdato: december år T

EBA's instrumentvaluta: GBP

116. Lang position i put-optioner. Underliggende instrument, AVIVA (ticker: AV/LN), 10 % OTM (1 kontrakt = 100 aktier).

Notionel værdi: svarende til værdien af 10 000 aktier af det underliggende aktiv

Udløbsdato: december år T

EBA's instrumentvaluta: GBP

117. Kort position i futures, NIKKEI 225 (ticker NKY).

Notionel værdi: svarende til værdien af indekset ganget med 20 000 JPY

Børs: CME

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: JPY

118. Aktieprodukt, auto-callable.

Lang position

Opførelse i handelsbeholdningen på »datoen for opførelsen i handelsbeholdningen«

Notionel værdi (»kapital«): 1 000 000 EUR

Underliggende instrument: Indeks, EURO STOXX 50 (ticker: SX5E)

EBA's instrumentvaluta: EUR

Løbetid: 5 år

Årlig udbetaling og årlig observation (»dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 1 år«, »dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 2 år«, »dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 3 år«, »dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 4 år«, »dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 5 år«). Udbetaling sker 10 dage efter referencedatoen.

Kupon: 6 %

Autocallniveau (»oprindelig værdi«): Ved dagens afslutning på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen + 1 måned

Grænsekuponbetaling 60 % af autocallniveau

Sikkerhedsgrænse: 55 % af autocallniveau

— Kapitalen er ikke garanteret, hvis indekset er under sikkerhedsgrænsen (kapitaludbyttet i år 5 vil være pro rata, hvis niveauet er under sikkerhedsgrænsen: Eksempel: Hvis SX5E = 40 % af det oprindelige niveau, er kapitaludbyttet 40 %).

— Hvis SX5E ≥ 60 % (grænsekupon) af den oprindelige værdi ved årets udgang, udbetales 6 % af kuponen.

— Hvis SX5E ≥ 100 % af den oprindelige værdi ved årets udgang, sælges produktet, og kuponen udbetales plus kapitalen (100 %).

— Hvis SX5E < 60 % (grænsekupon) af den oprindelige værdi ved årets udgang, udbetales ingen kupon.

— Hvis SX5E < 55 % (sikkerhedsgrænse) af den oprindelige værdi ved udgangen af år 5, udbetales kapitalen kun pro rata. Ellers gælder det, at hvis SX5E >= 55 % (sikkerhedsgrænse) af den oprindelige værdi ved udgangen af år 5, udbetales kapitalen fuldt ud.

119. Lang position i call-optioner. Underliggende indeks EUROSTOXX 50 (ticker: SX5E), ATM.

Notionel værdi: svarende til værdien af indekset gange 1 000 EUR

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

120. Lang position i call-optioner. Underliggende indeks EUROSTOXX 600 (ticker: SXXP), ATM.

Notionel værdi: svarende til værdien af indekset gange 10 000 EUR

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: EUR

121. Lang position i call-optioner. Underliggende VIX (CBOE), ATM.

Notionel værdi: svarende til værdien af indekset ganget med 100 000 USD

Udløbsdato: juni år T

EBA's instrumentvaluta: USD

IR

201. 5-års renteswap EUR — modtag fast rente, og betal variabel rente.

Fast ben: modtag årligt

Variabel rente: seksmåneders EURIBOR, betal halvårligt. Optælling af dage: Faktisk antal dage/360

Notionel værdi: 10 000 000 EUR

Roll-konvention og -tidsplan: standard

Startdato på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen (dvs. de rentesatser, der skal anvendes, er rentesatserne ved handelsdagens afslutning fra datoen for opførelsen i handelsbeholdningen)

Løbetid: september år T+4

EBA's instrumentvaluta: EUR

202. Toårig EUR-swaption på 5-årig renteswap EUR — betal fast rente, og modtag variabel rente.

Notionel værdi: 10 000 000 EUR.

Det er instituttet, der sælger optionen på swappen. Instituttets modpart køber retten til at indgå en swap med instituttet; hvis modparten udnytter sin ret, skal denne modtage den faste rente, mens instituttet skal modtage den variable rente.

Swaption med løbetid på to år (Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 2 år) på den renteswapsats, der er defineret som følger: Fast ben — betal årligt. Variabel rente: seksmåneders EURIBOR, modtag halvårligt. Notionel værdi: 10 000 000 EUR. Roll-konvention og -tidsplan: standard. Startdato for den underliggende swap: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 2 år.

Løbetid for den underliggende swap: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 7 år

Præmie betales på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen (dato for opførelsen i handelsbeholdningen). Afvikles kontant

Strikekursen er baseret på ATM-kursen for den swap, der starter i fremtiden, og er defineret ved dette instrument

EBA's instrumentvaluta: EUR

203. Femårs-renteswap USD. Modtag fast rente, og betal variabel rente.

Fast rente: modtag årligt

Variabel rente: tremåneders USD SOFR-rente, betal kvartalsvis

Notionel værdi: 1 000 000 USD

Roll-konvention og -tidsplan: standard

Startdato på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen (dvs. de rentesatser, der skal anvendes, er rentesatserne ved handelsdagens afslutning fra datoen for opførelsen i handelsbeholdningen)

Udløbsdato: september år T+4

EBA's instrumentvaluta: USD

204. Toårs-renteswap GBP. Modtag fast rente, og betal variabel rente.

Fast rente: modtag årligt

Variabel rente: SONIA-rente (dag-til-dag), sammensat og betalt kvartalsvis. Optælling af dage: Faktisk antal dage/365

Notionel værdi: 10 000 000 GBP

Roll-konvention og -tidsplan: standard

Startdato på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen (dvs. de rentesatser, der skal anvendes, er rentesatserne ved handelsdagens afslutning fra datoen for opførelsen i handelsbeholdningen)

Løbetid: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 2 år

EBA's instrumentvaluta GBP

205. Obligationer med rentecollar og variabel rente og en løbetid på 10 år solgt af UBS.

Notionel hovedstol: 1 000 000 USD

Obligationer med variabel rente (»obligationerne«) er ikkeefterstillede usikrede forpligtelser fra UBS AG (»UBS«).

EBA's instrumentvaluta USD

— Obligationerne skal have en årlig rente lig med tre måneders USD SOFR-rente plus 1,5 % årligt (»den variable rente«), hvor der er en maksimalrente på 7,5 % om året (»renteloftet«) og en minimumsrente på 2,5 % om året (»rentegulvet«).

— Alle betalinger i forbindelse med obligationerne, herunder renter og hovedstol ved forfald, forudsætter, at UBS AG er kreditværdig. Institutterne bør anvende en passende diskonteringskurve, som de begrunder i den forklarende note.

— Indtægter: Der udbetales renter på obligationerne kvartalsvis til en sats, der er lig med den variable rente, under forudsætning af følgende: hvis i) den variable rente på en kuponfastsættelsesdato ligger under rentegulvet, vil den gældende rente for den relaterede renteperiode være lig med rentegulvet, eller hvis ii) den variable rente på en kuponfastsættelsesdato ligger over renteloftet, vil den gældende rente for den relaterede renteperiode være lig med renteloftet.

Beløb for rentebetaling	Det rentebeløb, der skal betales på obligationerne for en renteperiode, skal være lig med produktet af: a) obligationernes hovedstol, b) den gældende rente for renteperioden og c) en brøkdel, hvis tæller er antallet af dage i renteperioden (beregnet på grundlag af et år på 360 dage bestående af 12 måneder på 30 dage), og hvis nævner er 360.
Handels- og afviklingsdato	»Dato for opførelsen i handelsbeholdningen«
Datoer for rentebetaling	Kvartalsvis, på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen + 3 måneder, datoen for opførelsen i handelsbeholdningen + 6 måneder, datoen for opførelsen i handelsbeholdningen + 9 måneder og datoen for opførelsen i handelsbeholdningen + 1 år fra datoen for opførelsen i handelsbeholdningen + 3 måneder, i obligationernes løbetid (underlagt justeringer, som beskrevet deri).
Udløbsdato:	Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 10 år
Valuta	USD
Grundlag for beregning af dage	30/360
Arbejdsdagskonvention	Following Unadjusted
Kuponfastsættelsesdato Dato	For hver renteperiode, den anden bankdag i London umiddelbart før den relevante rentedato. Bankdag i London: enhver dag, på hvilken forretningsbanker er åbne for almindelig virksomhed (herunder handel med fremmed valuta og indskud i fremmed valuta) i London, og på hvilken der gennemføres transaktioner i USD på Londons interbankmarked.

206. Lang position, GERMANY GOVT (Inflation) 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030583).

Løbetid: 15. april 2033

EBA's instrumentvaluta: EUR

207. Kort position, GERMANY GOVT 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030708).

Løbetid: 15. august 2030

EBA's instrumentvaluta: EUR

208. Lang position, ITALY GOVT (Inflation) 1 000 000 EUR (ISIN IT0005138828).

Løbetid: 15. september 2032

EBA's instrumentvaluta: EUR

209. Lang position, ITALY GOVT 1 000 000 EUR (ISIN IT0005340929).

Løbetid: 1. december 2028

EBA's instrumentvaluta: EUR

210. Lang position, SPAIN GOVT 1 000 000 EUR (ISIN ES00000127A2).

Løbetid: 30. juli 2030

EBA's instrumentvaluta: EUR

211. Kort position, FRANCE GOVT 1 000 000 EUR (ISIN FR0012993103).

Løbetid: 25. maj 2031

EBA's instrumentvaluta: EUR

212. Kort position, GERMANY GOVT 1 000 000 EUR (ISIN DE0001135176).

Løbetid: 4. januar 2031

EBA's instrumentvaluta: EUR

213. Lang position, UNITED KINGDOM GOVT 1 000 000 GBP (ISIN GB0004893086).

Løbetid: 7. juni 2032

EBA's instrumentvaluta: GBP

214. Lang position, PORTUGAL GOVT 1 000 000 EUR (ISIN PTOTEXOE0024).

Løbetid: 15. juni 2029

EBA's instrumentvaluta: EUR

215. Kort position, UNITED STATES GOVT 1 000 000 USD (ISIN US91282CAV37).

Løbetid: 15. november 2030

EBA's instrumentvaluta USD

216. Lang position, BRAZIL GOVT (callable) 1 000 000 USD (ISIN US105756BZ27).

Løbetid: 13. januar 2028

EBA's instrumentvaluta: USD

217. Lang position, MEXICO GOVT (callable) 1 000 000 USD (ISIN US91087BAT70).

Løbetid: 19. maj 2033

EBA's instrumentvaluta USD

218. 10-års-IRS EURO — modtag variabel rente, og betal fast rente.

Fast ben: betal årligt

Variabel rente: tremåneders EURIBOR-rente, modtag kvartalsvis. Optælling af dage: Faktisk antal dage/360

Notionel værdi: 10 000 000 EUR

Roll-konvention og -tidsplan: standard

Startdato på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen (dvs. de rentesatser, der skal anvendes, er rentesatserne ved handelsdagens afslutning på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen).

Løbetid: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 10 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

219. Femårs renteswap EURO — modtag variabel rente, og betal fast rente.

Fast ben: betal årligt

Variabel rente: seksmåneders EURIBOR-rente, modtag hver sjette måned. Optælling af dage: Faktisk antal dage/360

Notionel værdi: 10 000 000 EUR

Roll-konvention og -tidsplan: standard

Startdato på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen (dvs. de rentesatser, der skal anvendes, er rentesatserne ved handelsdagens afslutning på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen).

Løbetid: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 5 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

220. Femårs-Mark to Market-valutaswap EUR/USD. Modtag USD og betal EUR.

EUR: tremåneders ESTER-rente, betal kvartalsvis sammensat med to dages betalingsforsinkelse. Optælling af dage: Faktisk antal dage/360

USD: tremåneders SOFR-rente, modtag kvartalsvis sammensat med to dages betalingsforsinkelse. Optælling af dage: Faktisk antal dage/360

Ben 1 — USD: Notionel værdi 10 000 000 EUR, modværdi justeret kvartalsvis

Ben 2 — EUR: Notionel værdi 10 000 000 EUR

Roll-konvention og -tidsplan: standard

Startdato på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen + 6 måneder

Løbetid: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 5,5 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

Se også dette bilags afsnit 6 — Yderligere specifikationer for instrumenter

221. 10-årig renteswap EURO — modtag ESTER-rente, og betal EURIBOR-rente.

ESTER renteben: modtag årligt. Optælling af dage: Faktisk antal dage/360

EURIBOR renteben: tremåneders EURIBOR + basis, betal kvartalsvis. Optælling af dage: Faktisk antal dage/360

Notionel værdi: 10 000 000 EUR

Roll-konvention og -tidsplan: standard

Startdato på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen (dvs. de rentesatser, der skal anvendes, er rentesatserne ved handelsdagens afslutning fra datoen for opførelsen i handelsbeholdningen)

Løbetid: september år T + 9 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

222. Lang position, ITALY GOVT (Inflation) 1 000 000 EUR (ISIN IT0005387052).

Løbetid: 15. maj 2030

EBA's instrumentvaluta: EUR

223. 5-års nulkuponinflationsswap EUR — modtag inflationsindekseret afkast, og betal fast rente (r).

Inflationsindeks: CPI (HICPxT)

Fast ben (betal fast): $[(1 + r)^5 - 1]$

Modtag inflationsindekseret afkast: $\left[\left(\frac{CPI \text{ ved afslutning (udløbs)dato}}{CPI \text{ ved startdato}}\right) - 1\right]$

Notionel værdi: 10 000 000 EUR

Tidspunkt for fastsættelse af basis: juni år T-1

Endelig fastsættelse: august år T + 4

Løbetid: september år T+4

EBA's instrumentvaluta: EUR

224. Toårig EUR-swaption på 5-årig renteswap EUR — modtag fast rente, og betal variabel rente.

Notionel værdi: 10 000 000 EUR.

Det er instituttet, der sælger optionen på swappen. Instituttets modpart køber retten til at indgå en swap med instituttet; hvis modparten udnytter sin ret, skal denne modtage den variable rente, mens instituttet skal modtage den faste rente.

Swaption med løbetid på to år (Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 2 år) på den renteswapsats, der er defineret som følger: Fast ben - modtag årligt. Variabel rente: seksmåneders EURIBOR-rente, betal hver sjette måned. Notionel værdi: 10 000 000 EUR. Roll-konvention og -tidsplan: standard. Startdato for den underliggende swap: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 2 år.

Løbetid for den underliggende swap: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 7 år

Præmie betales på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen (dato for opførelsen i handelsbeholdningen). Afvikles kontant

Strikekursen er baseret på ATM-kursen for den swap, der starter i fremtiden og er defineret ved dette instrument + 100 basispoint

EBA's instrumentvaluta: EUR

FX

301. Seksmåneders USD/EUR-terminskontrakt. Afvikles kontant. Lang position, USD — Kort position, EUR. Notionel værdi 10 000 000 USD. Terminstrikekurs: svarer til 100 % af ECB's referencekurs ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

EBA's instrumentvaluta: EUR

302. Seksmåneders EUR/GBP-terminskontrakt. Afvikles kontant. Lang position, EUR — Kort position, GBP. Notionel værdi,
10 000 000 GBP. Terminstrikekurs: svarer til 100 % af ECB's referencekurs ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

EBA's instrumentvaluta: EUR

303. Lang position 10 000 000 USD Kontant.

Kontantposition. For at kunne anses for at have uløseligt forbundet valutarisiko som beskrevet i punkt kk).

EBA's instrumentvaluta: EUR

304. Lang position i EUR/USD call-option (lang EUR, kort USD). Afvikles kontant. Notionel værdi: 10 000 000 EUR. Modværdi baseret på ECB's referencespotkurs for EUR/USD ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

Strikekurs: 110 % af ECB's referencekurs for EUR/USD ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

Udløbsdato: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 1 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

305. Lang position i EUR/USD call-option (lang EUR, kort USD). Afvikles kontant. Notionel værdi: 10 000 000 EUR. Modværdi baseret på ECB's referencespotkurs for EUR/USD ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

Strikekurs: 90 % af ECB's referencekurs for EUR/USD ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

Udløbsdato: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 1 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

306. Kort position i EUR/USD call-option (kort EUR, lang USD). Afvikles kontant. Notionel værdi: 10 000 000 EUR. Modværdi baseret på ECB's referencespotkurs for EUR/USD ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

Strikekurs: 100 % af ECB's referencekurs for EUR/USD ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

Udløbsdato: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 1 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

307. Kort position i EUR/GBP call-option (kort EUR, lang GBP). Afvikles kontant. Notionel værdi: 10 000 000 EUR. Modværdi baseret på ECB's referencespotkurs for EUR/GBP ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

Strikekurs: 110 % af ECB's referencekurs for EUR/GBP ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen

Udløbsdato: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 1 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

308. Lang position i EUR/JPY put-option (kort EUR, lang JPY). Afvikles kontant. Notionel værdi: 10 000 000 EUR. Modværdi baseret på ECB's referencespotkurs for EUR/JPY ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

Strikekurs: 110 % af ECB's referencekurs for EUR/JPY ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen

Udløbsdato: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 1 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

309. Kort position i EUR/AUD put-option (lang EUR, kort AUD). Afvikles kontant. Notionel værdi: 10 000 000 EUR. Modværdi baseret på ECB's referencespotkurs for EUR/AUD ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

Strikekurs: 110 % af ECB's referencekurs for EUR/AUD ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen

Udløbsdato: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 1 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

310. Seksmåneders EUR/DKK-terminskontrakt (lang EUR, kort DKK). Afvikles kontant. Notionel værdi 10 000 000 EUR. ECB's referencespotkurs for EUR/DKK ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen for at bestemme terminskursen.

EBA's instrumentvaluta: EUR

311. Seksmåneders EUR/BRL ikkeleverbar terminskontrakt (lang EUR, kort BRL). Notionel værdi 10 000 000 EUR. ECB's referencespotkurs for EUR/BRL ved afslutningen på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen for at bestemme terminskursen.

EBA's instrumentvaluta: EUR

RÅVARER

401. Lang position,
3 500 troy ounces seksmåneders London Gold Forward (lang guld, kort USD). Afvikles kontant. Strikekurs: seksmånedersterminskurs ved dagens afslutning på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

EBA's instrumentvaluta: USD

402. Kort position, 3 500 troy ounces 12-måneders London Gold Forward (kort guld, lang USD). Afvikles kontant. Strikekurs: 12-månedersterminskurs ved dagens afslutning på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen

EBA's instrumentvaluta: USD

403. Lang position i call-option, 30 000 tønder Brent-råolie (lang WTI, kort USD). Afvikles kontant. Strikekurs: 12-månedersterminskurs ved dagens afslutning på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen. Udløbsdato: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 6 måneder

EBA's instrumentvaluta USD

404. Kort position i put-option, 30 000 tønder Brent-råolie (lang WTI, kort USD). Afvikles kontant. Strikekurs: 12-månedersterminskurs ved dagens afslutning på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen. Udløbsdato: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 6 måneder

EBA's instrumentvaluta USD

405. Lang position i call-option, 5 000 troy ounces London Gold Forward (lang guld, kort USD). Afvikles kontant. Strikekurs: 18-månedersterminskurs ved dagens afslutning på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen. Udløbsdato: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 18 måneder

EBA's instrumentvaluta: USD

KREDITSPÆND

501. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på PORTUGAL.

Omstruktureringsklausul: FULD

EBA's instrumentvaluta: USD

502. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på ITALY.

Omstruktureringsklausul: FULD
EBA's instrumentvaluta: USD

503. Kort position (dvs. sælg beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på SPANIEN.

Omstruktureringsklausul: FULD
EBA's instrumentvaluta: USD

504. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på MEXICO.

Omstruktureringsklausul: FULD
EBA's instrumentvaluta: USD

505. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på BRAZIL.

Omstruktureringsklausul: FULD
EBA's instrumentvaluta: USD

506. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på UK.

Omstruktureringsklausul: FULD
EBA's instrumentvaluta: USD

507. Kort position (dvs. sælg beskyttelse), 1 000 000 EUR, CDS på Telefonica (ticker TEF SM).

EBA's instrumentvaluta: EUR

508. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 EUR, CDS på Telefonica (ticker TEF SM).

Løbetid: december år T+2
EBA's instrumentvaluta: EUR

509. Kort position (dvs. sælg beskyttelse), 1 000 000 EUR, CDS på Aviva (Ticker AV LN).

ISDA-definitioner år 2003
EBA's instrumentvaluta: EUR

510. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 EUR, CDS på Aviva (Ticker AV LN).

ISDA-definitioner år 2003
Løbetid: december år T+2
EBA's instrumentvaluta: EUR

511. Kort position (dvs. sælg beskyttelse), 1 000 000 EUR, CDS på Vodafone (Ticker VOD LN).

EBA's instrumentvaluta: EUR

512. Kort position (dvs. sælg beskyttelse), 1 000 000 EUR, CDS på ENI SpA (Ticker ENI IM).

EBA's instrumentvaluta: EUR

513. Kort position (dvs. sælg beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på Eli Lilly (Ticker LLY US).

Omstruktureringsklausul: Ingen omstrukturering (XR14)
EBA's instrumentvaluta: USD

514. Kort position (dvs. sælg beskyttelse), 1 000 000 EUR, CDS på Unilever (Ticker UNA NA).

EBA's instrumentvaluta: EUR

515. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 EUR, CDS på Total SA (Ticker FP FP).

EBA's instrumentvaluta: EUR

516. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 EUR, CDS på Volkswagen Group (Ticker VOW GR).

EBA's instrumentvaluta: EUR

517. Lang position på TURKEY Govt.-obligationer, 1 000 000 USD (ISIN US900123CT57).

Løbetid: 26. april 2029

EBA's instrumentvaluta: USD

518. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på TYRKIET. Startdato på datoen for opførelsen i handelsbeholdningen.

Omstruktureringsklausul: FULD

EBA's instrumentvaluta: USD

519. Lang position på Telefonica-obligationer, 1 000 000 EUR (ISIN XS1681521081).

Løbetid: 12. januar 2028

EBA's instrumentvaluta: EUR

520. Lang position på Volkswagen Group-obligationer, 1 000 000 EUR (ISIN XS2234567233).

Løbetid: 22. september 2028

EBA's instrumentvaluta: EUR

521. Kort position på Volkswagen Group-obligationer, 1 000 000 EUR (ISIN XS1167667283).

Løbetid: 16. januar 2030

EBA's instrumentvaluta: EUR

522. Lang position på Total SA-obligationer, 1 000 000 EUR (ISIN XS1856281834).

Løbetid: 11. juli 2033

EBA's instrumentvaluta: EUR

523. Lang position, AUSTRIA GOVT 1 000 000 EUR (ISIN AT0000A04967).

Løbetid: 15. marts 2037

EBA's instrumentvaluta: EUR

524. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på AUSTRIA.

Løbetid: juni år T+15

EBA's instrumentvaluta: USD

525. Lang position, NETHERLANDS GOVT 1 000 000 EUR (ISIN NL0013552060).

Løbetid: 15. januar 2040

EBA's instrumentvaluta: EUR

526. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på NETHERLANDS.

Løbetid: juni år T+20

EBA's instrumentvaluta: USD

527. Lang position, BELGIUM GOVT 1 000 000 EUR (ISIN BE0000348574).

Løbetid: 22. juni 2050

EBA's instrumentvaluta: EUR

528. Lang position (dvs. køb beskyttelse), 1 000 000 USD, CDS på BELGIUM.

Løbetid: juni år T+30

EBA's instrumentvaluta: USD

529. Lang position (køb beskyttelse) 10 000 000 EUR CDS på iTraxx Europe index on-the-run series.

Løbetid: juni år T+4

EBA's instrumentvaluta: EUR

530. Kort position i put-option. 10 000 000 EUR. Underliggende iTraxx Europe index on-the-run series (samme instrument som 529).

Strikekurs: ATM

Udløbsdato: Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 6 måneder

EBA's instrumentvaluta: EUR

531. Lang position, AXA SA (callable) 1 000 000 EUR (ISIN XS1799611642).

Løbetid: 28. maj 2049

EBA's instrumentvaluta: EUR

532. Lang position, AT&T Bond (callable) 1 000 000 USD (ISIN US00206RFW79).

Løbetid: 15. august 2037

EBA's instrumentvaluta: USD

533. Lang position, BAYER AG (callable) 1 000 000 EUR (ISIN XS2199266268).

Løbetid: 6. januar 2030

EBA's instrumentvaluta: EUR

534. Lang position, ORANGE SA Bond (callable) 1 000 000 EUR (ISIN FR0013323870).

Løbetid: 20. marts 2028

EBA's instrumentvaluta: EUR

CTP

601. Kort position (dvs. sælg beskyttelse) i iTraxx Europe index on-the-run series.

Attachment point: 3 %

Detachment point: 6 %

Notionel værdi: 5 000 000 EUR

Løbetid: 5 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

602. Lang position (køb beskyttelse) 5 000 000 EUR CDS på den seneste af iTraxx Europe index' on-the-run series.

Løbetid: juni år T+4

EBA's instrumentvaluta: EUR

Justeret notionel værdi med henblik på fuldstændig afdækning af CS01 i 601 uden krav om genafdækning

603. Lang position (dvs. køb beskyttelse) i iTraxx Europe index on-the-run series.

Attachment point: 3 %

Detachment point: 6 %

Notionel værdi: 5 000 000 EUR

Løbetid: 5 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

604. Kort position (dvs. sælg beskyttelse), 5 000 000 EUR, CDS på den seneste af iTraxx Europe index' on-the-run series.

Løbetid: juni år T+4

EBA's instrumentvaluta: EUR

Justeret notionel værdi med henblik på fuldstændig afdækning af CS01 i 603 uden krav om genafdækning

605. Kort position (dvs. sælg beskyttelse) i iTraxx Europe index on-the-run series.

Attachment point: 12 %

Detachment point: 100 %

Notionel værdi: 5 000 000 EUR

Løbetid: 5 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

606. Lang position (køb beskyttelse) 5 000 000 EUR CDS på den seneste af iTraxx Europe index on-the-run series.

Løbetid: juni år T+4

EBA's instrumentvaluta: EUR

Justeret notionel værdi med henblik på fuldstændig afdækning af CS01 i 605 uden krav om genafdækning

607. Lang position (dvs. køb beskyttelse) i iTraxx Europe index on-the-run series.

Attachment point: 12 %

Detachment point: 100 %

Notionel værdi: 5 000 000 EUR

Løbetid: 5 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

608. Kort position (dvs. sælg beskyttelse), 5 000 000 EUR, CDS på den seneste af iTraxx Europe index' on-the-run series.

Løbetid: juni år T+4

EBA's instrumentvaluta: EUR

Justeret notionel værdi med henblik på fuldstændig afdækning af CS01 i 607 uden krav om genafdækning

609. Kort position (dvs. sælg beskyttelse) i iTraxx Europe index on-the-run series.

Attachment point: 3 %

Detachment point: 6 %

Notionel værdi: 5 000 000 EUR

Løbetid: 5 år

EBA's instrumentvaluta: EUR

Inddrivelsesrate: 40 % fast.

610. Lang position (køb beskyttelse) 5 000 000 EUR CDS på den seneste af iTraxx Europe index on-the-run series.

Løbetid: juni år T+4

EBA's instrumentvaluta: EUR

Justeret notionel værdi med henblik på fuldstændig afdækning af CS01 i 609 uden krav om genafdækning

Afsnit 3: Individuelle porteføljer — Enkelt instrument

Institutterne angiver de påkrævede risikomålinger, sammen med nutidsværdien, for følgende individuelle porteføljer:

Portefølje	*Kombination af instrumenter:* Det første tal repræsenterer instrumentet (jf. dette bilags afsnit 2). Det andet tal repræsenterer mængden for hvert instrument eller antal kontrakter, alt efter hvad der er relevant.	EBA'S porteføljevaluta	Påkrævede risikomålinger
1001	101 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1002	102 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1003	103 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1004	104 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1005	105 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1006	106 — 1 instrument	GBP	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1007	107 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1008	108 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1009	109 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1010	110 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1011	111 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1012	112 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1013	113 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1014	114 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1015	115 — 1 instrument	GBP	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1016	116 — 1 instrument	GBP	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1017	117 — 1 instrument	JPY	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1018	118 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO

1019	119 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1020	120 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1021	121 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2001	201 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2002	202 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2003	203 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2004	204 — 1 instrument	GBP	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2005	205 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2006	206 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2007	207 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2008	208 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2009	209 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2010	210 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2011	211 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2012	212 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2013	213 — 1 instrument	GBP	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2014	214 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2015	215 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2016	216 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2017	217 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2018	218 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2019	219 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2020	220 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2021	221 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2022	222 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO

2023	223 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2024	224 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3001	301 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3002	302 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3003	303 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3004	304 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3005	305 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3006	306 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3007	307 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3008	308 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3009	309 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3010	310 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3011	311 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
4001	401 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
4002	402 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
4003	403 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
4004	404 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
4005	405 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
5001	501 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5002	502 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5003	503 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5004	504 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5005	505 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5006	506 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5007	507 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO

5008	508 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5009	509 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5010	510 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5011	511 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5012	512 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5013	513 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5014	514 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5015	515 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5016	516 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5017	517 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5018	518 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5019	519 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5020	520 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5021	521 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5022	522 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5023	523 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5024	524 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5025	525 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5026	526 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5027	527 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5028	528 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5029	529 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5030	530 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5031	531 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5032	532 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO

5033	533 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5034	534 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
6001	601 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6002	602 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6003	603 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6004	604 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6005	605 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6006	606 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6007	607 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6008	608 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6009	609 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6010	610 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO

Afsnit 4: Individuelle porteføljer — Flere instrumenter

Institutterne angiver de påkrævede risikomålinger, sammen med nutidsværdien, for følgende individuelle porteføljer:

Portefølje	*Kombination af instrumenter*: Det første tal repræsenterer instrumentet (jf. dette bilags afsnit 2). Det andet tal repræsenterer mængden for hvert instrument eller antal kontrakter, alt efter hvad der er relevant.	EBA'S porteføljeva-luta	Påkrævede risikomålinger
1101	103 — 1 instrument 104 — 1 instrument 105 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1102	113 — 1 instrument 110 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1103	115 — 1 instrument 116 — 1 instrument	GBP	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1104	109 — 1 instrument 110 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO

1105	111 — 1 instrument 112 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1106	102 — 1 instrument 114 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1107	106 — 1 instrument 107 — 1 instrument 108 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1108	101 — 1 instrument 103 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1109	101 — 1 instrument 103 — 1 instrument 104 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
1110	102 — 1 instrument 104 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2201	206 — 1 instrument 207 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2202	206 — 1 instrument 207 — 1 instrument 208 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2203	206 — 1 instrument 207 — 1 instrument 208 — 1 instrument 209 — 1 instrument 210 — 1 instrument 211 — 1 instrument 212 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2204	201 — 1 instrument 218 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2205	201 — 1 instrument 219 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2206	218 — 1 instrument 219 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2207	201 — 1 instrument 202 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
2208	215 — 1 instrument 216 — 1 instrument 217 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2209	203 — 1 instrument 215 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO

2210	208 — 1 instrument 209 — 1 instrument 210 — 1 instrument 214 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2211	209 — 1 instrument 219 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
2212	201 — 1 instrument 223 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3301	301 — 1 instrument 302 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3302	303 — 1 instrument 304 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3303	304 — 1 instrument 305 — 1 instrument 306 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
3304	307 — 1 instrument 308 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
4401	401 — 1 instrument 402 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
4402	403 — 1 instrument 404 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
4403	401 — 1 instrument 404 — 1 instrument	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
5501	501 — 1 instrument 502 — 1 instrument 503 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5502	504 — 1 instrument 505 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5503	507 — 1 instrument 508 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5504	503 — 1 instrument 504 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5505	509 — 1 instrument 510 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5506	511 — 1 instrument 512 — 1 instrument 514 — 1 instrument 515 — 1 instrument 516 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO

5507	517 — 1 instrument 518 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5508	519 — 1 instrument 520 — 1 instrument 522 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5509	520 — 1 instrument 521 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5510	519 — 1 instrument 508 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5511	515 — 1 instrument 522 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5512	520 — 1 instrument 521 — 1 instrument 516 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5513	506 — 1 instrument 503 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5514	502 — 1 instrument 209 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5515	504 — 1 instrument 217 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5516	505 — 1 instrument 216 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5517	504 — 1 instrument 217 — 1 instrument 505 — 1 instrument 216 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5518	502 — 1 instrument 209 — 1 instrument 219 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5519	523 — 1 instrument 525 — 1 instrument 527 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5520	524 — 1 instrument 526 — 1 instrument 528 — 1 instrument	USD	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
5521	523 — 1 instrument 524 — 1 instrument 525 — 1 instrument 526 — 1 instrument 527 — 1 instrument 528 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO

5522	529 — 1 instrument 530 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
6601	601 — 1 instrument 602 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6602	603 — 1 instrument 604 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6603	605 — 1 instrument 606 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6604	607 — 1 instrument 608 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO
6605	609 — 1 instrument 610 — 1 instrument	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO

Afsnit 5: Aggregerede porteføljer

Institutterne angiver de påkrævede risikomålinger, sammen med nutidsværdien, for følgende finansielle aggregerede porteføljer:

Aggregeret Portefølje	Beskrivelse	*Kombination af individuelle porteføljer* (individuelle porteføljer som angivet ved tallene som omhandlet i dette bilags afsnit 3 og 4)	EBA'S porteføljeva-luta	Påkrævede risikomålinger
10000	ALL-IN uden for korrelationshan-delsportefølje	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
11000	AKTIER kumulativ	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
12000	RENTE kumulativ	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
13000	VALUTA kumulativ	3301, 3303, 3304	EUR	VaR sVaR SBM DRC RRAO
14000	Råvarer kumulativ	4401, 4402	USD	VaR sVaR SBM DRC RRAO
15000	Kreditspænd kumulativ	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR sVaR IRC SBM DRC RRAO
16000	Korrelationshan-delsportefølje kumulativ EUR	6601, 6602	EUR	VaR sVaR APR SBM DRC RRAO

Afsnit 6: Yderligere specifikationer for instrumenter

Institutterne anvender følgende yderligere specifikationer på de finansielle instrumenter, der er beskrevet i dette bilags afsnit 2:

Instrument:	220
Beskrivelse:	Femårs-Mark to Market-valutaswap EUR/USD Modtag USD og betal EUR Notionel værdi: 10 000 000 EUR, USD (10 000 000 EUR * FX USD/EUR)
Betal:	Variabelt ben 2
Modtag:	Variabelt ben 1
Notionel værdi — ombytning og tilpasning:	På startdatoen og udløbsdatoen. Endvidere foretages der på hver kuponbetalingsdato en yderligere betaling svarende til justeringen af den notionelle værdi i USD for det variable ben 2. Den notionelle værdi i USD justeres til et niveau svarende til 10 000 000 EUR til spotkurs to arbejdsdage før hver betalingsdato.
Kassebeholdning	Omfattet
Variabelt ben 1	
Notionel værdi:	10 000 000 EUR modværdi omregnet til USD-spotkurs på startdatoen, modværdi justeret kvartalsvis
Startdato:	Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 6 måneder
Udløbsdato:	Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 5,5 år
Generering af betalingsdatoer:	Fremad i tid fra startdatoen
Betalingshyppighed, kupon:	Kvartalsvis
Kuponrente:	tremåneders SOFR-rente + 0 basispoint
Tilpasningshyppighed, kuponrente:	Kvartalsvis
Konvention om fastsættelse af kuponrente:	Sammensat dagligt i løbet af tremånedersperioden
Sammensætningshyppighed, kuponrente:	Simpel rente
Optælling af dage:	Faktisk antal dage/360
Arbejdsdag, betaling:	LON, NYC, TARGET
Arbejdsdagskonvention om betaling:	Modified Following
Arbejdsdag, tilpasning af notionel værdi:	LON, NYC, TARGET
Arbejdsdagskonvention om tilpasning af notionel værdi:	Foregående
Arbejdsdag, tilpasning af kuponrente:	LON, NYC, TARGET
Arbejdsdagskonvention om tilpasning af kuponrente:	Foregående

Variabelt ben 2	
Notionel værdi:	10 000 000 EUR
Startdato:	Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 6 måneder
Udløbsdato:	Dato for opførelsen i handelsbeholdningen + 5,5 år
Generering af betalingsdatoer:	Fremad i tid fra startdatoen
Betalingshyppighed, kupon:	Kvartalsvis
Kuponrente:	tremåneders ESTER-rente + 0 basispoint
Tilpasningshyppighed, kuponrente:	Kvartalsvis
Konvention om fastsættelse af kuponrente:	Sammensat dagligt i løbet af tremånedersperioden
Sammensætningshyppighed, kuponrente:	Simpel rente
Optælling af dage:	Faktisk antal dage/360
Arbejdsdag, betaling:	LON, NYC, TARGET
Arbejdsdag, betaling	Modified Following
Arbejdsdag, tilpasning af notionel værdi:	LON, NYC, TARGET
Arbejdsdagskonvention om tilpasning af notionel værdi:	Foregående
Arbejdsdag, tilpasning af kuponrente:	LON, NYC, TARGET
Arbejdsdagskonvention om tilpasning af kuponrente:	Foregående”

Afsnit 7: Valideringsporteføljer for SBM

a) Institutterne skal levere SBM-risikomålingen for de porteføljer, der er defineret i bilag X (valideringsporteføljer for SBM), som en del af IMV-indberetningen og indberette dem i overensstemmelse med indberetningsdatoerne for IMV-indberetningen.

b) Følgende gælder for indberetning af resultater svarende til SBM-valideringsporteføljer:

   i. Institutterne skal kun indberette skema C 120.02 og begrænse indberetningen i dette skema til resultaterne vedrørende indberetningsvaluta (dvs. at kolonne 0060 i skema C 120.02 ikke udfyldes, og at skema C 106.00 og C 106.01 ikke indberettes for SBM-valideringsporteføljerne)

   ii. Institutterne skal antage, at de risikofølsomheder og curvaturerisikoeksponeringer, der er defineret ved de i bilag X angivne instrumenter, er udtrykt i instituttets indberetningsvaluta i det format, der er fastsat i indberetningsinstrukserne til skema C 106.01/C 120.01 og i den tilsvarende tabel med vejledning med hensyn til indberetningen af disse skemaer i bilag VI (instrukser til skemaer).«

BILAG III

»BILAG VI

RESULTATER FOR BENCHMARKPORTEFØLJER MED HENBLIK PÅ TILSYN

INSTRUKSER VEDRØRENDE SKEMAERNE

C 106.00 — Indledende markedsvurdering og begrundelse for udeladelse 57
C 106.01 — Følsomhedsmetoden (»SBM«). Risikofølsomhed efter instrument 57
C 107.01 — VaR og sVaR uden for CTP. Oplysninger. 61
C 107.02 — VaR, sVaR og nutidsværdi (»PV«) — uden for CTP. Resultater udtrykt i EBA's porteføljevaluta 63
C 108.00 — Tidsserie: gevinst og tab 64
C 109.01 — IRC. Oplysninger om modellen 65
C 109.02 — IRC. Oplysninger efter portefølje 65
C 109.03 — IRC. Værdi efter portefølje/dato 66
C 110.01 — Korrelationshandel (CT). Oplysninger om modellen 67
C 110.02 — Korrelationshandel (CT). Oplysninger efter portefølje 68
C 110.03 — Korrelationshandel (CT). Alle prisrisici (APR) efter portefølje/dato 69
C 120.01 — SBM. RISIKOFØLSOMHEDER EFTER INSTRUMENT/PORTEFØLJE 69
C 120.02 — SBM. OFR-SAMMENSÆTNING EFTER PORTEFØLJE 72
C 120.04 — DRC. MARKEDSVÆRDIER OG BRUTTO-JTD EFTER INSTRUMENT/PORTEFØLJE 74
C 120.05 — DRC. OFR-SAMMENSÆTNING EFTER PORTEFØLJE 80
C 120.06 — ASA. OFR 82

INSTRUKSER VEDRØRENDE SKEMAERNE

C 106.00 — Indledende markedsvurdering og begrundelse for udeladelse

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Instrumentnummer	Afsnit 2 i bilag V	Her indberettes instrumentnummeret fra bilag V.
0020	Instrument modelberegnet for value-at-risk (»VaR«) og VaR i stresssituationer (»sVaR«) (TRUE/FALSE)		Her angives enten TRUE eller FALSE.
0030	Instrument modelberegnet for forøget misligholdelses- og migreringsrisiko (»IRC«) (TRUE/FALSE)		Her angives enten TRUE eller FALSE.
0040	Instrument modelberegnet for korrelationshandel (TRUE/FALSE)		Her angives enten TRUE eller FALSE.
0050	Begrundelse for udeladelse	Artikel 3, stk. 2	Et af følgende indberettes: (a) Modellen er ikke tilladt af reguleringsmyndigheden. (b) Instrumentet eller det underliggende aktiv er ikke tilladt internt. (c) Der tages ikke hensyn internt til det underliggende aktiv eller modelberegningskendetegnet. (d) Anden begrundelse for udeladelse. Redegør herfor i kolonne 0060.
0060	Fritekstfelt		I denne kolonne kan et institut fremsætte yderligere oplysninger.
0070	Indledende markedsvurdering (IMV)		Mark-to-market-værdien af hvert instrument på referencedatoen kl. 17:30 CET (som omhandlet i bilag V, afsnit 1, litra b). Cellen udfyldes ikke, hvis instituttet ikke ønsker at oplyse en IMV for en bestemt portefølje (dvs. nulværdier indberettes kun, hvis resultatet af beregningen er nul).

C 106.01 — Følsomhedsmetoden (»SBM«). Risikofølsomhed efter instrument

Her indberettes institutterne følsomheder over for risikofaktorer, som instrumentet eksponeres mod. Der udfyldes én række pr. risikofaktor/følsomhed. Den opadgående nettocurvaturerisikoposition for den pågældende risikofaktor (CVRk+) og den nedadgående nettocurvaturerisikoposition for den pågældende risikofaktor (CVRk-), som er beskrevet i artikel 325g i forordning (EU) nr. 575/2013, indberettes i individuelle rækker. Alle værdier henviser til »IMV-referencedatoen (og indledende SBM)« som beskrevet i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b), nr. ii). Institutterne indberetter kun hver enkelt kombination af instrumentnummer, risikoidentifikator (kolonne 0010), undergruppe (kolonne 0020) og yderligere identifikator (kolonne 0030) én gang.

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Instrumentnummer	Afsnit 2 i bilag V	Her indberettes instrumentnummeret fra bilag V.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Risikofaktoridentifikator	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p og 325q i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes risikofaktoridentifikatoren, således som den er beskrevet i tabellen i slutningen af dette bilag.
0020	Undergruppe	Artikel 325d, stk. 3, i forordning (EU) nr. 575/2013	Her angives undergruppen, hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0010, svarer til én af følgende risikoklasser: — For almindelig renterisiko angives navnet på valutaen for den relevante risikofrie rente, inflation eller valutabasisrisikofaktor (efter valutabetegnelsen i ISO 4217, f.eks. »EUR«). — For kreditspændsrisikoen for ikkesecuritiseringsinstrumenter angives undergruppenummeret i artikel 325ah, stk. 1, tabel 4, i forordning (EU) nr. 575/2013. — For kreditspændsrisikoen for securitisering, der ikke indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR uden for ACTP), angives undergruppenummeret i nævnte forordnings artikel 325am, stk. 1, tabel 7. — For kreditspændsrisikoen for securitiseringer, der indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR i ACTP), angives undergruppenummeret i nævnte forordnings artikel 325ak, tabel 6. — For aktierisiko angives undergruppenummeret i nævnte forordnings artikel 325ap, stk. 1, tabel 8. — For råvarerisiko angives undergruppenummeret i nævnte forordnings artikel 325as, tabel 9. — For valutarisiko og komponenterne Delta eller Curvature angives navnet på valutaen (f.eks. »USD«, de indberettede valutakoder skal følge valutabetegnelsen i ISO 4217). — For valutarisiko og komponenten Vega angives navnet på valutaparret (f.eks. »EUR_USD«, de indberettede valutakoder skal følge valutabetegnelsen i ISO 4217).
0030	Yderligere identifikator 1	Artikel 325l til 325q og 325ai i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes følgende oplysninger, som gør det muligt at skelne mellem risikofaktorer inden for undergruppen. Hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0010, svarer til én af følgende risikoklasser: — For almindelige renterisikofaktorer og komponenten Delta, angives navnet på den risikofrie kurve eller en anden dertil svarende unik identifikator. — For kreditspændsrisikoen for ikkesecuritiseringsinstrumenter eller for risikoklassen kreditspændsrisiko for securitiseringer, der indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR i ACTP), angives udsteders navn eller en anden dertil

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			svarende unik identifikator, og den skal være identisk med to indberettede følsomheder over for to risikofaktorer, som har et korrelationsparameter $\rho_{kl}^{(name)}$ lig med 1 i overensstemmelse med artikel 325ai, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013. — For kreditspændsrisikoen for securitiseringer, der ikke indgår i den alternative korrelationshandelsporteføljе (CSR uden for ACTP), angives navnet på tranchen eller en anden dertil svarende unik identifikator. — For aktierisiko angives aktieudsteders navn eller en dertil svarende unik identifikator. — For råvarerisiko angives råvarens navn eller en anden dertil svarende unik identifikator. Hvis ingen af disse tilfælde gør sig gældende, angiver institutterne en udtrykkelig værdi (NULL) som ikke relevant.
0050	Risikofølsomhed (resultater udtrykt i indberetningsvaluta)	Artikel 325d, stk. 2, og artikel 325g, 325r, 325s, 325t og 325ax i forordning (EU) nr. 575/2013	For hvert instrument indberettes risikofølsomheder (delta- og vegafølsomheder og curvaturerisikopositioner) for alle relevante risikofaktorer som beskrevet i kolonne 0010-0030. Værdierne indberettes i instituttets indberetningsvaluta. Hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0010, svarer til: — Deltarisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, indberettes nettofølsomheden for risikofaktoren (S_k) som beskrevet i artikel 325r i forordning (EU) nr. 575/2013 Hvis institutterne har opnået tilladelse fra deres kompetente myndighed til at anvende alternative definitioner af deltarisikofølsomheder i overensstemmelse med nævnte forordnings artikel 325t, stk. 5, henviser de til disse alternative definitioner i forbindelse med indberetningen. — Vegarisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, indberettes en options vegarisikofølsomhed over for en given risikofaktor (S_k) som beskrevet i artikel 325s i forordning (EU) nr. 575/2013. Hvis institutterne har opnået tilladelse fra deres kompetente myndighed til at anvende alternative beregninger af vegarisikofølsomheder i overensstemmelse med nævnte forordnings artikel 325t, stk. 6, henviser de til disse alternative beregninger i forbindelse med indberetningen. Uanset om instituttet anvender definitionen i artikel 325s eller en alternativ beregning i overensstemmelse med ovennævnte forordnings artikel 325t, stk. 6, indberettes følsomheden efter vægtning heraf med den dertil svarende implicitte volatilitet. — Curvaturerisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, indberettes den opadgående nettocurvaturerisikoposition for den pågældende risikofaktor (CVR_k^+) og den nedadgående nettocurvaturerisikoposition for den pågældende risikofaktor (CVR_k^-) som beskrevet i artikel 325g i forordning (EU) nr. 575/2013. Det indberettede tal skal udtrykkes som en decimal med en minimumspræcision på to decimaler. Nulværdier indberettes kun, hvis resultatet af beregningen rent faktisk er nul.
0060	Indberetningsvaluta		Her indberettes navnet på instituttets indberetningsvaluta (den indberettede værdi følger valutabetegnelsen i ISO 4217, f.eks. »EUR«).

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0070	Risikofølsomhed (resultater udtrykt i EBA-instrumentets valuta)	Afsnit 2 i bilag V til nærværende forordning og Artikel 325d, stk. 2, og artikel 325g, 325r og 325s i forordning (EU) nr. 575/2013	Værdierne indberettes efter instrukserne for kolonne 0050, men de konverteres til den ECB-valutaspotkurs, der er forbundet med instrumentets valuta, som defineret i nærværende forordnings bilag V, afsnit 2.
0080	Værdiansættelses-model	Artikel 325t i forordning (EU) nr. 575/2013	Her præciserer instituttet, hvilken værdiansættelsesmodel der anvendes for at udlede følsomhederne. Et af følgende indberettes: (a) »Instituttets værdiansættelsesmodeller, der tjener som basis for indberetning af overskud og tab til den øverste ledelse« (jf. artikel 325t, stk. 1, første afsnit, i forordning (EU) nr. 575/2013) (b) »Instituttets metode med interne modeller« (jf. nævnte forordnings artikel 325t, stk. 1, andet afsnit)
0090	Definition af følsomheder	Artikel 325r, 325s og 325t i forordning (EU) nr. 575/2013	Her præciserer instituttet, hvilken definition af følsomheder der anvendes ved beregningen af kapitalgrundlagskravene. Et af følgende indberettes: (a) »definitionen af følsomheder i artikel 325g og artikel 325r i forordning (EU) nr. 575/2013« (b) »definitionen af følsomheder i artikel 325t, stk. 5 og 6, i forordning (EU) nr. 575/2013« Hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0010, svarer til curvaturerisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, indberettes den værdi, der er angivet i litra b), såfremt nogen af de følsomheder, der er anvendt i beregningen af den indberettede curvaturerisikoposition, er baseret på en definition af følsomheder i overensstemmelse med artikel 325t, stk. 5 og 6, i forordning (EU) nr. 575/2013, og den værdi, der er angivet i litra a), på anden vis.
0100	Fritekstfelt		Et institut kan give yderligere oplysninger i denne kolonne vedrørende den anvendte værdiansættelsesmodel og definition af følsomheder.
0110	Yderligere identifikator2	Artikel 325p, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0010, svarer til risikoklassen råvarerisiko og deltarisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, angives det sæt retlige vilkår, som vedrører leveringsstedet, eller en anden dertil svarende unik identifikator. Hvis ingen af disse tilfælde gør sig gældende, angiver institutterne en udtrykkelig værdi (NULL) som ikke relevant.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0120	Kreditkvalitetskategori	Artikel 325m, stk. 1, og artikel 325ah, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0010, svarer til risikoklassen kreditspændsrisikoen for ikkesecuritiseringsinstrumenter og deltarisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, angives én af følgende: (a) »CQS 1« (b) »CQS 2« (c) »CQS 3« (d) »CQS 4« (e) »CQS 5« (f) »CQS 6« (g) »Ingen tildelt CQS (ikkerated)«. Hvis ingen af disse tilfælde gør sig gældende, angiver institutterne en udtrykkelig værdi (NULL) som ikke relevant.

C 107.01 — VaR og sVaR uden for CTP. Oplysninger.

Række	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010-0060	VaR		
0010	Metode		Et af følgende indberettes i kolonne 0010: (a) Historisk simulering (b) Monte-Carlo-simulering (c) Parametrisk metode (d) Kombination / anden metode (angives nærmere). Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010. Hvis mulighed d) blev valgt i kolonne 0010, redegør instituttet nærmere herfor i kolonne 0020.
0020	Beregning af 10-dagesperiode	Artikel 365, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013	Et af følgende indberettes i kolonne 0010: (a) 1 dag reskaleret til 10 dage (b) 10 dage med overlappende perioder (c) 10 dage efter anden metode. Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010.
0030	Observationsperiodens længde	Artikel 365, stk. 1, litra d), i forordning (EU) nr. 575/2013	Et af følgende indberettes i kolonne 0010: (a) op til 1 år (b) over 1 og op til 2 år (c) over 2 og op til 3 år (d) over 3 år. Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010.

Række	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0040	Datavægtning	Artikel 365, stk. 1, litra d), i forordning (EU) nr. 575/2013	Et af følgende indberettes i kolonne 0010: (a) uvægtet (VaR-datavægtning) (b) vægtet (VaR-datavægtning) (c) største værdi af vægtet og uvægtet (VaR-datavægtning) litra a) og b). Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010.
0050	Backtestingtillæg	Artikel 366, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Backtestingtillæg betyder plusfaktoren mellem 0 og 1, jf. artikel 366, stk. 2, tabel 1, i forordning (EU) nr. 575/2013 Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010.
0060	Obligatorisk VaR-tillæg	Artikel 366, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013 (»mindst 3«)	Det obligatoriske VaR-tillæg er det ekstra tillæg, der pålægges af den kompetente myndighed med hensyn til multiplikationsfaktoren for VaR (mindst 3) i overensstemmelse med artikel 366, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013. Det obligatoriske VaR-tillæg er summen af backtestingtillægget og af det kvalitative tillæg, hvor det er relevant, ud over 3. Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010.
0070-0100	sVaR (dvs. VaR i stresssituationer)		
0070	Metode		Et af følgende indberettes i kolonne 0010: (a) Historisk simulering (b) Monte-Carlo-simulering (c) Parametrisk metode (d) Kombination / anden metode (angives nærmere). Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010. Hvis mulighed d) blev valgt i kolonne 0010, redegør instituttet nærmere herfor i kolonne 0020.
0080	Beregning af 10-dagesperiode	Artikel 365, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013	Et af følgende indberettes i kolonne 0010: (a) 1 dag reskaleret til 10 dage (b) 10 dage med overlappende perioder (c) 10 dage efter anden metode. Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010.
0090	Obligatorisk sVaR-tillæg	Artikel 366, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Det obligatoriske tillæg er det ekstra tillæg, der pålægges af den kompetente myndighed med hensyn til multiplikationsfaktoren for sVaR (mindst 3) i overensstemmelse med artikel 366, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013. Det obligatoriske tillæg er summen af 3, backtestingtillægget og det kvalitative tillæg (hvor det er relevant).

Række	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010.
0100	Periode for sVaR	Artikel 365, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Et af følgende indberettes i kolonne 0010: (a) daglig beregning af sVaR kalibreret til en sammenhængende 12-månedersperiode, der begynder fra datoen i kolonne 0020 (b) ugentlig beregning af sVaR kalibreret til en sammenhængende 12-månedersperiode, der begynder fra datoen i kolonne 0020 (c) daglig beregning af sVaR kalibreret til forskellige sammenhængende 12-månedersperioder inden for indberetningsdatoerne for sVaR i kolonne 0010 i C107.02, der begynder fra datoerne i kolonne 0020 (d) ugentlig beregning af sVaR kalibreret til forskellige sammenhængende 12-månedersperioder inden for indberetningsdatoerne for sVaR i kolonne 0010 i C107.02, der begynder fra datoerne i kolonne 0020 (e) maksimum af daglig beregning af sVaR kalibreret til mere end en 12-månedersperiode (f) maksimum af ugentlig beregning af sVaR kalibreret til mere end en 12-månedersperiode (g) andre valg for kalibrering af sVaR (angiv nærmere). Instituttet anvender kolonne 0020 til at angive startdatoen i formatet »dd/mm/åååå«, hvis a) eller b) er anført i kolonne 0010, og de startdatoer, i formatet »dd/mm/åååå«, der anvendes til hver beregning af sVaR, hvis c) eller d) er anført i kolonne 0010. Instituttet anvender også kolonne 0020 til at give nærmere oplysninger om den 12-månedersperiode, der anvendes for hver beregning af sVaR, hvis e), f) eller g) er anført i kolonne 0010.

C 107.02 — VaR, sVaR og nutidsværdi (»PV«) — uden for CTP. Resultater udtrykt i EBA's porteføljevaluta

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Portefølje	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Her indberettes porteføljenummeret fra bilag V.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Dato		Her indberettes resultater for VaR, sVaR og PV for alle 10 arbejdsdage mellem den »indledende referencedato for risikomålinger« og den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« som angivet i bilag V, afsnit 1, litra b). Konventionen »dd/mm/åååå« anvendes til indberetningen af datoer.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0020	VaR	Artikel 365 i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes den obligatoriske 10-dages-VaR opnået for hver individuel portefølje, uden anvendelse af den lovgivningsmæssige multiplikationsfaktor »mindst 3«. Der indberettes tal for hver af de i kolonne 0010 anførte datoer. Cellen udfyldes ikke, hvis instituttet ikke beregner VaR på den i kolonne 0010 anførte dato (dvs. nulværdier indberettes kun, hvis resultatet af beregningen er nul).
0030	sVaR	Artikel 365 i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes den obligatoriske 10-dages-sVaR opnået for hver individuel portefølje, uden anvendelse af den obligatoriske multiplikationsfaktor »mindst 3«. Der indberettes tal for hver af de i kolonne 0010 anførte datoer. Cellen udfyldes ikke, hvis instituttet ikke beregner sVaR på den i kolonne 0010 anførte dato (dvs. nulværdier indberettes kun, hvis resultatet af beregningen er nul).
0040	PV		Her indberettes nutidsværdien (»PV«) for hver portefølje. Der indberettes tal for hver af de i kolonne 0010 anførte datoer. Cellen udfyldes ikke, hvis instituttet ikke beregner PV på den i kolonne 0010 anførte dato (dvs. nulværdier indberettes kun, hvis resultatet af beregningen er nul).

C 108.00 — Tidsserie: gevinst og tab

Skema C 108.00 (Tidsserie: gevinst og tab) udfyldes kun af institutter, der beregner VaR ved hjælp af historisk simulering.

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Portefølje	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Her indberettes porteføljenummeret fra bilag V.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Dato	Artikel 365, stk. 1, litra d), i forordning (EU) nr. 575/2013	På hver arbejdsdag bestemt i overensstemmelse med kalenderen i instituttets jurisdiktion oplyser instituttet den gevinst og tab-serie, der anvendes til at beregne VaR i C.107.02, kolonne 0010, med mindst 250 observationer, der begynder fra den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)«, som beskrevet i bilag V, afsnit 1, litra b), nr. v), og går bagud i tid.
0020	Daglig gevinst og tab (P&L)		Institutter, der beregner VaR ved hjælp af historisk simulering, udfylder hele den kronologiske serie, de anvender, med mindst en etårsdataserie, med den porteføljeværdiændring (dvs. daglig gevinst og tab), der genereres ved at anvende historisk simulerede daglige risikofaktorændringer (dvs. den daglige gevinst og tab-serie, der bruges til at udlede den obligatoriske 1-dags VaR).

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			Hvis en dag ikke er en arbejdsdag i den relevante jurisdiktion, skal denne celle ikke udfyldes (dvs. der indberettes kun nul for gevinst og tab, hvis der ikke var nogen ændring i den hypotetiske værdi af porteføljen på en given arbejdsdag).

C 109.01 — IRC. Oplysninger om modellen

Række	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Antal modelberegningsfaktorer		EBA/GL/2012/3 Her indberettes antallet af modelberegningsfaktorer på det overordnede IRC-modelniveau. Svaret er et af følgende: (a) 1 modelberegningsfaktor (b) 2 modelberegningsfaktorer (c) Over 2 modelberegningsfaktorer. Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010.
0020	Kilde til LGD'er		EBA/GL/2012/3 Her indberettes kilden til LGD'er på det overordnede IRC-modelniveau. Svaret er et af følgende: (a) Markedskonvention (b) LGD anvendt i IRB (c) Anden kilde til LGD (angiv nærmere). Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010. Hvis mulighed c) blev valgt i kolonne 0010, redegør instituttet nærmere herfor i denne kolonne.

C 109.02 — IRC. Oplysninger efter portefølje

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Portefølje	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Porteføljenummeret fra bilag V, kun for de porteføljer, hvor en model for forøget misligholdelses- og migreringsrisiko er påkrævet.

Række	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Likviditetshorisont	Artikel 374, stk. 5, i forordning (EU) nr. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Her indberettes den likviditetshorisont, der anvendes på porteføljeniveau. Svaret er et af følgende: (a) op til 3 måneder (b) over 3 og op til 6 måneder (c) over 6 og op til 9 måneder (d) over 9 og op til 12 måneder.
0020	Kilde til PD'er		EBA/GL/2012/3 Her indberettes den kilde til PD'er, der anvendes på porteføljeniveau. Svaret er et af følgende: (a) ratingbureauer (b) IRB (c) markedsudledte PD'er (d) anden kilde til PD'er (angiv nærmere). Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010. Hvis mulighed d) blev valgt i kolonne 0010, redegør instituttet nærmere herfor i kolonne 0020.
0030	Kilde til transitionsmatricer		EBA/GL/2012/3 Her indberettes den kilde til transitionsmatricer, der anvendes på porteføljeniveau. Svaret er et af følgende: (a) ratingbureauer (b) IRB (c) markedsudledte transitionsmatricer (d) andre kilder til transitionsmatricer (angiv nærmere). Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010. Hvis mulighed d) blev valgt i kolonne 0010, redegør instituttet nærmere herfor i kolonne 0020.

C 109.03 — IRC. Værdi efter portefølje/dato

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Portefølje	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Porteføljenummeret fra bilag V, kun for de porteføljer, hvor en model for forøget misligholdelses- og migreringsrisiko er påkrævet.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Dato		Her indberettes IRC for alle 10 arbejdsdage mellem den »indledende referencedato for risikomålinger« og den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« som angivet i bilag V, afsnit 1, litra b). Konventionen »dd/mm/åååå« anvendes til indberetningen af datoer.
0020	IRC	Artikel 372-376 i forordning (EU) nr. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Her indberettes den obligatoriske IRC, der er opnået for hver porteføljе. Der indberettes tal for hver af de i kolonne 0010 anførte datoer. Cellen udfyldes ikke, hvis instituttet ikke beregner IRC på den i kolonne 0010 anførte dato (dvs. nulværdier indberettes kun, hvis resultatet af beregningen er nul).

C 110.01 — Korrelationshandel (CT). Oplysninger om modellen

Række	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Antal modelberegningsfaktorer	Artikel 377 i forordning (EU) nr. 575/2013	Antallet af modelberegningsfaktorer på det overordnede korrelationshandelsmodelniveau indberettes. Svaret er et af følgende: (a) 1 modelberegningsfaktor (b) 2 modelberegningsfaktorer (c) Over 2 modelberegningsfaktorer. Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010.
0020	Kilde til LGD'er	Artikel 377 i forordning (EU) nr. 575/2013	Kilden til LGD'er på det overordnede korrelationshandelsmodelniveau indberettes. Svaret er et af følgende: (a) Markedskonvention (b) LGD anvendt i IRB (c) Andre kilder til LGD (angiv nærmere). Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010. Hvis mulighed c) blev valgt i kolonne 0010, redegør instituttet nærmere herfor i denne kolonne.

C 110.02 — Korrelationshandel (CT). Oplysninger efter porteføljе

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Porteføljе	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Porteføljenummeret fra bilag V, kun for de porteføljer, hvor alle prisrisici er påkrævet.

Række	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Likviditetshorisont	Artikel 377, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes den likviditetshorisont, der anvendes på porteføljeniveau. Svaret er et af følgende: (a) op til 3 måneder (b) over 3 og op til 6 måneder (c) over 6 og op til 9 måneder (d) over 9 og op til 12 måneder.
0020	Kilde til PD'er	Artikel 377 i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes den kilde til PD'er, der anvendes på porteføljeniveau. Svaret er et af følgende: (a) ratingbureauer (b) IRB (c) markedsudledte PD'er (d) anden kilde til PD'er (angiv nærmere). Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010. Hvis mulighed d) blev valgt i kolonne 0010, redegør instituttet nærmere herfor i kolonne 0020.
0030	Kilde til transitionsmatricer	Artikel 377 i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes den kilde til de transitionsmatricer, der anvendes på porteføljeniveau. Svaret er et af følgende: (a) ratingbureauer (b) IRB (c) markedsudledte transitionsmatricer (d) anden kilde til transitionsmatricer (angiv nærmere). Institutterne anvender kolonne 0020 til at uddybe svaret i kolonne 0010. Hvis mulighed d) blev valgt i kolonne 0010, redegør instituttet nærmere herfor i kolonne 0020.

C 110.03 — Korrelationshandel (CT). Alle prisrisici (APR) efter portefølje/dato

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Portefølje	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Porteføljenummeret fra bilag V, kun for de porteføljer, hvor alle prisrisici er påkrævet.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Dato	Artikel 377 i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes alle prisrisici for alle 10 arbejdsdage mellem den »indledende referencedato for risikomålinger« og den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« som angivet i bilag V, afsnit 1, litra b). Konventionen »dd/mm/åååå« anvendes til indberetningen af datoer.
0060	Alle prisrisici	Artikel 377 i forordning (EU) nr. 575/2013	De resultater, der er opnået ved at anvende den obligatoriske korrelationshandelsmodel på hver portefølje. Der indberettes tal for hver af de i kolonne 0010 anførte datoer. Cellen udfyldes ikke, hvis instituttet ikke anvender en korrelationshandelsmodel på den i kolonne 0010 anførte dato (dvs. nulværdier indberettes kun, hvis resultatet af beregningen er nul).

C 120.01 — SBM. RISIKOFØLSOMHEDER EFTER INSTRUMENT/PORTEFØLJE

Her indberetter institutterne for hvert enkelt instrument følsomheder over for risikofaktorer, som det pågældende instrument eksponeres mod. Der udfyldes én række pr. risikofaktor/følsomhed. Den opadgående nettocurvaturerisikoposition for den pågældende risikofaktor (CVRk+) og den nedadgående nettocurvaturerisikoposition for den pågældende risikofaktor (CVRk-), som er beskrevet i artikel 325g i forordning (EU) nr. 575/2013, indberettes i individuelle rækker. Alle værdier skal henvise til den »endelige referencedato for risikomålinger (og endelig ASA)« (som defineret i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b), nr. v)). Institutterne indberetter kun hver enkelt kombination af portefølje, instrumentnummer (kolonne 0010), risikoidentifikator (kolonne 0020), undergruppe (kolonne 0030) og yderligere identifikator (kolonne 0040) én gang.

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Portefølje	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Her indberettes porteføljens nummer fra bilag V.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Instrumentnummer	Afsnit 2 i bilag V	Her indberettes instrumentnummeret fra bilag V.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0020	Risikofaktoridenti-fikator	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p og 325q i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes risikofaktoridentifikatoren, således som den er beskrevet i tabellen i slutningen af dette bilag.
0030	Undergruppe	Artikel 325d, stk. 3, i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes undergruppen, hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0020, svarer til én af følgende risikoklasser: — Almindelig renterisiko. Her angives navnet på valutaen for den relevante risikofrie rente, inflation eller valutabasisrisikofaktor (efter valutabetegnelsen i ISO 4217, f.eks. »EUR«). — Kreditspændsrisikoen for ikkesecuritiseringsinstrumenter. Her angives undergruppenummeret i artikel 325ah, stk. 1, tabel 4, i forordning (EU) nr. 575/2013. — Kreditspændsrisikoen for securitiseringer, der ikke indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR uden for ACTP). Her angives undergruppenummeret i nævnte forordnings artikel 325am, stk. 1, tabel 7. — Kreditspændsrisikoen for securitiseringer, der indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR i ACTP). Her angives undergruppenummeret i nævnte forordnings artikel 325ak, tabel 6. — Aktierisiko. Her angives undergruppenummeret i nævnte forordnings artikel 325ap, stk. 1, tabel 8. — Råvarerisiko. Her angives undergruppenummeret i nævnte forordnings artikel 325as, tabel 9. — Valutarisiko og komponenterne Delta eller Curvature. Her angives navnet på den valuta (f.eks. »USD«, de indberettede valutakoder skal følge valutabetegnelsen i ISO 4217). — Valutarisiko og komponenten Vega. Her angives navnet på valutaparret (f.eks. »EUR_USD«, de indberettede valutakoder skal følge valutabetegnelsen i ISO 4217).
0040	Yderligere identifikator 1	Artikel 325l til 325q og artikel 325ai i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes følgende oplysninger, som gør det muligt at skelne mellem risikofaktorer inden for undergruppen. Hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0020, svarer til én af følgende risikoklasser: — For almindelige renterisikofaktorer og komponenten Delta, angives navnet på den risikofrie kurve eller en anden dertil svarende unik identifikator. — For kreditspændsrisikoen for ikkesecuritiseringsinstrumenter eller for risikoklassen kreditspændsrisiko for securitiseringer, der indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR i ACTP), angives udsteders navn eller en anden dertil svarende unik identifikator, og den skal være identisk med to indberettede følsomheder over for to risikofaktorer, som har et korrelationsparameter $\rho_{kl}^{(name)}$ lig med 1 i overensstemmelse med artikel 325ai, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013. — For kreditspændsrisikoen for securitiseringer, der ikke indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR uden for ACTP), angives navnet på tranchen eller en anden dertil svarende unik identifikator. — For aktierisiko angives aktieudsteders navn eller en dertil svarende unik identifikator.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			— For råvarerisiko angives råvarens navn eller en anden dertil svarende unik identifikator. Hvis ingen af disse tilfælde gør sig gældende, angiver institutterne en udtrykkelig værdi (NULL) som ikke relevant.
0060	Risikofølsomhed (resultater udtrykt i indberetningsvaluta)	Artikel 325d, stk. 2, og artikel 325g, 325r, 325s, 325t og 325ax i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes risikofølsomheder (delta- og vegafølsomheder og curvaturerisikopositioner) for hvert instrument for alle relevante risikofaktorer som beskrevet i kolonne 0020-0040. Værdierne indberettes i instituttets indberetningsvaluta. Hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0020, svarer til: — Deltarisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, indberettes nettofølsomheden for risikofaktoren (S_k) som beskrevet i artikel 325r i forordning (EU) nr. 575/2013 Hvis institutterne har opnået tilladelse fra deres kompetente myndighed til at anvende alternative beregninger af deltarisikofølsomheder i overensstemmelse med nævnte forordnings artikel 325t, stk. 5, henviser de til disse alternative definitioner i forbindelse med indberetningen. — Vegarisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, indberettes en options vegarisikofølsomhed over for en given risikofaktor (S_k) som beskrevet i artikel 325s i forordning (EU) nr. 575/2013. Hvis institutterne har opnået tilladelse fra deres kompetente myndighed til at anvende alternative beregninger af vegarisikofølsomheder i overensstemmelse med nævnte forordnings artikel 325t, stk. 6, henviser de til disse alternative beregninger i forbindelse med indberetningen. Uanset om instituttet anvender beregningen i artikel 325s eller en alternativ beregning i overensstemmelse med ovennævnte forordningens artikel 325t, stk. 6, indberettes følsomheden efter vægtning heraf med den dertil svarende implicitte volatilitet. — Curvaturerisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, indberettes den opadgående nettocurvaturerisikoposition for den pågældende risikofaktor (CVR_k^+) og den nedadgående nettocurvaturerisikoposition for den pågældende risikofaktor (CVR_k^-) som beskrevet i artikel 325g i forordning (EU) nr. 575/2013. Det indberettede tal skal udtrykkes som en decimal med en minimumspræcision på to decimaler. Nulværdier indberettes kun, hvis resultatet af beregningen rent faktisk er nul.
0070	Indberetningsvaluta		Her indberettes navnet på instituttets indberetningsvaluta (den indberettede værdi følger valutabetegnelsen i ISO 4217, f.eks. »EUR«).
0080	Risikofølsomhed (resultater udtrykt i EBA's porteføljevaluta)	Afsnit 3 og 4 i bilag V til nærværende forordning og Artikel 325d, stk. 2, og artikel 325g, 325r, 325s, 325t og 325ax i forordning (EU) nr. 575/2013	Værdierne indberettes efter instrukserne for kolonne 0060, men de konverteres til den ECB-valutaspotkurs, der er forbundet med porteføljens valuta, som defineret i nærværende forordnings bilag V, afsnit 3 og 4.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0090	Risikovægt	Tredje del, afsnit IV, kapitel 1a, afdeling 6, i forordning (EU) nr. 575/2013	Den risikovægt, der svarer til risikofaktoren som beskrevet i kolonne 0020 til 0040, indberettes. Hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0020, svarer til curvaturerisikokomponenten, indberettes den risikovægt, der anvendt til at bestemme det relevante relative skift. Det indberettede tal skal udtrykkes som en decimal med en minimumspræcision på fire decimaler.
0110	Yderligere identifikator2	Artikel 325p, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0010, svarer til risikoklassen råvarerisiko og deltarisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, angives det sæt retlige vilkår, som vedrører leveringsstedet, eller en anden dertil svarende unik identifikator. Hvis ingen af disse tilfælde gør sig gældende, angiver institutterne en udtrykkelig værdi (NULL) som ikke relevant.
0120	Kreditkvalitetskategori	Artikel 325m, stk. 1, og artikel 325ah, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den risikofaktoridentifikator, der vælges i kolonne 0010, svarer til risikoklassen kreditspændsrisikoen for ikkesecuritiseringsinstrumenter og deltarisikokomponenten efter følsomhedsmetoden, angives én af følgende: (a) »CQS 1« (b) »CQS 2« (c) »CQS 3« (d) »CQS 4« (e) »CQS 5« (f) »CQS 6« (g) »Ingen tildelt CQS (ikkerated)«. Hvis ingen af disse tilfælde gør sig gældende, angiver institutterne en udtrykkelig værdi (NULL) som ikke relevant.

C 120.02 — SBM. OFR-SAMMENSÆTNING EFTER PORTEFØLJE

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Portefølje	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Her indberettes porteføljens nummer fra bilag V.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Risikoklasse	Artikel 325d, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes risikoklassen. Svaret er et af følgende: (a) »Almindelig renterisiko (GIRR)« (b) »Kreditspændsrisiko. CSR for ikkesecuritiseringsinstrumenter« (kreditspændsrisiko (SCR) for ikkesecuritiseringsinstrumenter) (c) »Kreditspændsrisiko. CSR uden for ACTP« (kreditspændsrisiko for securitiseringer, der ikke indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR uden for ACTP)) (d) »Kreditspændsrisiko. CSR i ACTP« (kreditspændsrisiko for securitiseringer, der indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR i ACTP)) (e) »Aktierisiko« (f) »Råvarerisiko« (g) »Valutarisiko«.
0020	Komponent	Artikel 325e, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes komponenten i følsomhedsmetoden. Svaret er et af følgende: (a) »Deltarisiko« (b) »Vegarisiko« (c) »Curvaturerisiko«.
0030	Korrelationsscenarie	Artikel 325h i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes korrelationsscenariet. Svaret er et af følgende: (a) »Scenariet mellemhøj korrelation« (b) »Scenariet høj korrelation« (c) »Scenariet lav korrelation«.
0040	Kapitalgrundlagskrav (resultater udtrykt i indberetningsvaluta)	Artikel 325h i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes for hver portefølje værdier for kapitalgrundlagskrav for den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« (som beskrevet i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b)) for alle relevante kombinationer af risikoklasse, komponent og korrelationsscenarie. Værdierne indberettes i instituttets indberetningsvaluta og udtrykkes med en minimumspræcision på to decimaler.
0050	Indberetningsvaluta		Her indberettes instituttets indberetningsvaluta (den indberettede værdi følger valutabetegnelsen i ISO 4217).
0060	Kapitalgrundlagskrav (resultater udtrykt i EBA's porteføljevaluta)	Nærværende forordnings bilag V, afsnit 3 og 4, og artikel 325h i forordning (EU) nr. 575/2013	Værdierne indberettes efter instrukserne for kolonne 0040, men de konverteres til den ECB-valutaspotkurs, der er forbundet med porteføljens valuta, som defineret i nærværende forordnings bilag V, afsnit 3 og 4.
0070	Positioner uden optionalitet, som er omfattet af kapitalgrundlagskrav vedrørende curvaturerisiko.	Artikel 325e, stk. 3, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis komponenten i kolonne 0020 svarer til curvaturerisiko: (a) Her angives »TRUE«, hvis instituttet anvender den metoder, der er fastsat i artikel 325e, stk. 3, første afsnit, i forordning (EU) nr. 575/2013, når det beregner det resultat, der indberettes i kolonne 0040 og 0060. (b) Her angives »FALSE« i andre tilfælde. Her angives også »FALSE«, hvis ingen af disse gør sig gældende.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0080	Metoden med basisvaluta som anvendt for delta- og curvaturevalutarisiko	Artikel 325q, stk. 7, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis risikoklassen i kolonne 0010 svarer til valutarisikoen og komponenten i kolonne 0020 svarer til deltarisiko eller curvaturerisiko: (a) Her angives »TRUE«, hvis instituttet anvender den metoder, der er fastsat i artikel 325q, stk. 7, i forordning (EU) nr. 575/2013, når det beregner det resultat, der indberettes i kolonne 0040 og 0060. (b) Her angives »FALSE« i andre tilfælde. Her angives også »FALSE«, hvis ingen af disse gør sig gældende.
0090	Opdeling af curvaturerisikokomponenter for valutarisiko efter skala	Artikel 325q, stk. 6, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis risikoklassen i kolonne 0010 svarer til valutarisikoen og komponenten i kolonne 0020 svarer til curvaturerisiko: (a) Her angives »TRUE«, hvis instituttet anvender den metoder, der er fastsat i artikel 325q, stk. 6, i forordning (EU) nr. 575/2013, når det beregner det resultat, der indberettes i kolonne 0040 og 0060. (b) Her angives »FALSE« i andre tilfælde. Her angives også »FALSE«, hvis ingen af disse gør sig gældende.
0095	Indberetning af SBM-valideringsporteføljeresultater	Artikel 325e, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den portefølje, der indberettes oplysninger om, er en SBM-valideringsportefølje, som omhandlet i bilag V, afsnit 7: a) Her angives »Indberettet«, hvis instituttet indberetter resultater svarende til denne portefølje b) Her angives »Ikke indberettet - ingen eksponering mod risikofaktor«, hvis instituttet vælger ikke at indberette resultater for den relevante SBM-valideringsportefølje, fordi der ikke foreligger nogen godkendelse fra det pågældende instituts ledelse til at handle med instrumenter, der medfører eksponering mod den relevante risikofaktor. Her angives »Ikke relevant«, hvis den portefølje, der indberettes oplysninger om, er en portefølje som omhandlet i bilag V, afsnit 3, 4 eller 5.
0100	Fritekstfelt		I denne kolonne kan et institut fremsætte yderligere oplysninger.

C 120.04 — DRC. MARKEDSVÆRDIER OG BRUTTO-JTD EFTER INSTRUMENT/PORTEFØLJE

Her indberetter institutterne for hvert enkelt instrument de eksponeringer, der svarer til instrumentet. Der udfyldes én række pr. eksponering. Alle værdier skal henvise til den »endelige referencedato for risikomålinger (og endelig ASA)« (som defineret i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b), nr. v)). Eksponeringer indberettes inden der foretages en eventuel modregning, men efter replikations- eller opdelingstrinnene (som defineret i artikel 325z og 325ac i forordning (EU) nr. 575/2013), hvis det er relevant.

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Portefølje	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Her indberettes porteføljens nummer fra bilag V.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Instrumentnummer	Afsnit 2 i bilag V	Her indberettes instrumentnummeret fra bilag V.
0020	Risikoklasse	Artikel 325v, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes den risikoklasse, for hvilken kravet vedrørende misligholdelsesrisiko (DRC) er indberettet i kolonne 0030 og 0040. Her angives én af følgende instrumenttyper: (a) »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner« (b) »securitiseringspositioner, som ikke indgår i ACTP« (c) »securitiseringspositioner, som indgår i ACTP«.
0030	Undergruppe1	Artikel 325y, stk. 3, artikel 325aa, stk. 4, og artikel 325ad, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Her angives undergruppen. Hvis den risikoklasse, der indberettes i kolonne 0020, svarer til »ikkesecuritiseringsinstrumenter«, angives ét af følgende: (a) »selskaber« (b) »stater« (c) »lokale myndigheder/kommunale myndigheder«. Hvis den risikoklasse, der indberettes i kolonne 0020, i stedet svarer til »securitiseringer«, som ikke indgår i ACTP, angives a) som ovenfor eller ét af følgende: (d) »ABCP — Asien« (e) »ABCP — Europa« (f) »ABCP — Nordamerika« (g) »ABCP — Resten af verden« (h) »Billån/-leasingkontrakter — Asien« (i) »Billån/-leasingkontrakter — Europa« (j) »Billån/-leasingkontrakter — Nordamerika« (k) »Billån/-leasingkontrakter — Resten af verden« (l) »Strukturerede kreditobligationer af typen »squared« (CDO-squared) — Asien« (m) »Strukturerede kreditobligationer af typen »squared« (CDO-squared) — Europa« (n) »Strukturerede kreditobligationer af typen »squared« (CDO-squared) — Nordamerika« (o) »Strukturerede kreditobligationer af typen »squared« (CDO-squared) — Resten af verden« (p) »Strukturerede låneobligationer (CLO) — Asien« (q) »Strukturerede låneobligationer (CLO) — Europa« (r) »Strukturerede låneobligationer (CLO) — Nordamerika« (s) »Strukturerede låneobligationer (CLO) — Resten af verden« (t) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsejendomslån (CMBS) — Asien« (u) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsejendomslån (CMBS) — Europa« (v) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsejendomslån (CMBS) — Nordamerika« (w) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsejendomslån (CMBS) — Resten af verden« (x) »Kreditkort — Asien« (y) »Kreditkort — Europa« (z) »Kreditkort — Nordamerika« (æ) »Kreditkort — Resten af verden« (ø) »Anden detailhandel — Asien« (å) »Anden detailhandel — Europa« (aa) »Anden detailhandel — Nordamerika«

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			(bb) »Anden detailhandel — Resten af verden« (cc) »Anden engroshandel — Asien« (dd) »Anden engroshandel — Europa« (ee) »Anden engroshandel — Nordamerika« (ff) »Anden engroshandel — Resten af verden« (gg) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i boliglån (RMBS) — Asien« (hh) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i boliglån (RMBS) — Europa« (ii) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i boliglån (RMBS) — Nordamerika« (jj) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i boliglån (RMBS) — Resten af verden« (kk) »Små og mellemstore virksomheder (SMV'er) — Asien« (ll) »Små og mellemstore virksomheder (SMV'er) — Europa« (mm) »Små og mellemstore virksomheder (SMV'er) — Nordamerika« (nn) »Små og mellemstore virksomheder (SMV'er) — Resten af verden« (oo) »Studielån — Asien« (pp) »Studielån — Europa« (qq) »Studielån — Nordamerika« (rr) »Studielån — Resten af verden«. Hvis den risikoklasse, der indberettes i kolonne 0020, i stedet svarer til »securitiseringer, som indgår i ACTP«, angives følgende svar: »securitiseringer, som indgår i ACTP«.
0040	Undergruppe2	Artikel 325ad, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den risikoklasse, der indberettes i kolonne 0020, svarer til »securitiseringer, som indgår i ACTP«, angives navnet på indekset og ellers en tom værdi (NUL).
0050	Låntager	Artikel 325v, stk. 2, artikel 325x, stk. 1 samt artikel 325z og 325ac i forordning (EU) nr. 575/2013	Institutterne indberetter oplysninger vedrørende låntager. Hvis den risikoklasse, der indberettes i kolonne 0020, svarer til: — »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner«, angives låntagers navn — »securitiseringspositioner, som ikke indgår i ACTP«, angives låntagers navn eller en unik identifikator, som betegner den underliggende aktivportefølje eller tranchen — »securitiseringspositioner, som indgår i ACTP«, angives den unikke identifikator, som betegner den underliggende indeksfamilie-, serie og -tranche.
0060	Kreditkvalitetskategori	Artikel 325y, stk. 1 og 2, artikel 325aa, stk. 1, og artikel 325ad, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013	Institutterne indberetter kreditkvaliteten. Svaret er et af følgende: (a) »CQS 1« (b) »CQS 2« (c) »CQS 3« (d) »CQS 4« (e) »CQS 5« (f) »CQS 6« (g) »Ingen tildelt CQS (ikkerated)«

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			(h) »Ingen tildelt CQS (misligholdt)« (i) »Ingen tildelt CQS (0 % risikovægt)«. Hvis den risikoklasse, der indberettes i kolonne 0020, svarer til »securitiseringer, som indgår i ACTP« eller »securitiseringer, som ikke indgår i ACTP«, angives ét af ovenstående eller ét af følgende svar: (j) »CQS 7« (k) »CQS 8« (l) »CQS 9« (m) »CQS 10« (n) »CQS 11« (o) »CQS 12« (p) »CQS 13« (q) »CQS 14« (r) »CQS 15« (s) »CQS 16« (t) »CQS 17« (u) »CQS Alle andre«.
0070	Vægt for misligholdelsesrisiko	Artikel 325v, stk. 1, litra f), artikel 325y, stk. 1 og 2, artikel 325aa, stk. 1, og artikel 325ad, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013	Institutterne indberetter den relevante vægt for misligholdelsesrisiko. Risikovægte, der er anvendt på securitiseringspositioner, indberettes efter multiplikation med 8 % i overensstemmelse med artikel 325aa, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013.
0080	Rangorden	Artikel 325w, stk. 3 og 6, i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes rangordenen for eksponeringen. Hvis den risikoklasse, der indberettes i kolonne 0020, svarer til »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner« eller »securitiseringspositioner, som ikke indgår i ACTP«, angives ét af følgende svar: (a) »aktieinstrumenter« (b) »efterstillede gældsinstrumenter« (c) »ikkeefterstillede gældsinstrumenter« (d) »dækkede obligationer«. Hvis ingen af disse gør sig gældende, udfyldes cellen ikke.
0090	Løbetid	Artikel 325x, 325z og 325ac i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes løbetiden for eksponeringen. Konventionen »dd/mm/åååå« anvendes til indberetningen af datoen.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0100	Inddrivelsesrate	Artikel 325v, stk. 1, litra e), i forordning (EU) nr. 575/2013	Institutterne indberetter inddrivelsesraten. Inddrivelsesraten beregner ved anvendelse af det relevante tab givet misligholdelse (LGD) som inddrivelsesrate = 1 - LGD. Det indberettede tal for inddrivelsesraten skal udtrykkes som en decimalværdi mellem 0 og 1 med en minimumspræcision på fire decimaler.
0110	Kategori	Artikel 325v, stk. 1, litra a) og b), i forordning (EU) nr. 575/2013	Institutterne indberetter eksponeringskategorien i overensstemmelse med definitionerne i artikel 325v, stk. 1, litra a) og b), i forordning (EU) nr. 575/2013. Svaret er et af følgende: (a) »kort eksponering« (b) »lang eksponering«.
0120	Attachment point (i %)	Artikel 325aa og 325ad i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den indberettede eksponering henviser til en tranche, indberetter institutterne attachment point for tranchen. Det indberettede tal skal udtrykkes som en decimal med en minimumspræcision på fire decimaler.
0130	Detachment point (i %)	Artikel 325aa og 325ad i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den indberettede eksponering henviser til en tranche, indberetter institutterne detachment point for tranchen. Det indberettede tal skal udtrykkes som en decimal med en minimumspræcision på fire decimaler.
0140-0170	Resultater udtrykt i indberetningsvaluta		Værdierne indberettes, idet der henvises til instituttets indberetningsvaluta og udtrykkes med en minimumspræcision på to decimaler, hvis det er relevant.
0140	Notionel værdi	Artikel 325w, stk. 1, 2 og 5, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den risikoklasse, der er indberettet i kolonne 0020, svarer til »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner«, indberetter institutterne instrumentets notionelle værdi. Værdien svarer til termen $V_{notional}$ i artikel 325w, stk. 1 og 2, i forordning (EU) nr. 575/2013 eller termen V i nævnte forordnings artikel 325w, stk. 5, afhængigt af typen af eksponering. Cellen skal stå tom, hvis ingen af disse tilfælde gør sig gældende, eller hvis instituttet ikke eksplicit beregner eller anvender den værdi, der skal indberettes i denne kolonne, med henblik på at estimere bruttobeløbet for pludselig misligholdelse (brutto-JTD).
0150	P&L + Adjustment	Artikel 325w, stk. 1, 2 og 5, i forordning (EU) nr. 575/2013	Institutterne indberetter summen af P&L og Adjustment for hver eksponering. — Hvis den risikoklasse, der er indberettet i kolonne 0020, svarer til »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner«, og den indberettede eksponering er en lang eksponering, indberetter institutterne summen af $P\&L_{long}$ og $Adjustment_{long}$ i overensstemmelse med artikel 325w, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013. — Hvis den risikoklasse, der er indberettet i kolonne 0020, svarer til »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner«, og den indberettede eksponering er en kort eksponering, indberetter institutterne summen af $P\&L_{long}$ og $Adjustment_{short}$ i overensstemmelse med nævnte forordnings artikel 325w, stk. 2.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			Cellen skal stå tom, hvis ingen af disse tilfælde gør sig gældende, eller hvis instituttet ikke eksplicit beregner eller anvender den værdi, der skal indberettes i denne kolonne, med henblik på at estimere brutto-JTD.
0160	Brutto-JTD	Artikel 325v, stk. 1, litra c), artikel 325w, stk. 1, 2 og 5, artikel 325z, stk. 1 og artikel 325ac, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Institutterne indberetter brutto-JTD for den specifikke eksponering.
0170	Valuta		Her indberettes instituttets indberetningsvaluta (den indberettede værdi følger valutabetegnelsen i ISO 4217).
0180-0200	Resultater udtrykt i EBA's porteføljevaluta	Bilag V, afsnit 3 og 4, og artikel 325y, 325aa og 325ad i forordning (EU) nr. 575/2013	Værdierne indberettes efter instrukserne for kolonne 0030, men de konverteres til den ECB-valutaspotkurs, der er forbundet med porteføljens valuta, som defineret i nærværende forordnings bilag V, afsnit 3 og 4.
0180	Notionel værdi	Artikel 325w, stk. 1, 2 og 5, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den risikoklasse, der er indberettet i kolonne 0020, svarer til »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner« , indberetter institutterne instrumentets notionelle værdi. Værdien svarer til termen $V_{notional}$ i artikel 325w, stk. 1 og 2, i forordning (EU) nr. 575/2013 eller termen V i nævnte forordnings artikel 325w, stk. 5, afhængigt af typen af eksponering. Cellen skal stå tom, hvis ingen af disse tilfælde gør sig gældende, eller hvis instituttet ikke eksplicit beregner eller anvender den værdi, der skal indberettes i denne kolonne, med henblik på at estimere brutto-JTD.
0190	P&L + Adjustment	Artikel 325w, stk. 1, 2 og 5, i forordning (EU) nr. 575/2013	Institutterne indberetter summen af P&L og Adjustment for hver eksponering. — Hvis den risikoklasse, der er indberettet i kolonne 0020, svarer til »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner«, og den indberettede eksponering er en lang eksponering, indberetter institutterne summen af $P\&L_{long}$ og $Adjustment_{long}$ i overensstemmelse med artikel 325w, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013. — Hvis den risikoklasse, der er indberettet i kolonne 0020, svarer til »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner«, og den indberettede eksponering er en kort eksponering, indberetter institutterne summen af $P\&L_{long}$ og $Adjustment_{short}$ i overensstemmelse med nævnte forordnings artikel 325w, stk. 2.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			Cellen skal stå tom, hvis ingen af disse tilfælde gør sig gældende, eller hvis instituttet ikke eksplicit beregner eller anvender den værdi, der skal indberettes i denne kolonne, med henblik på at estimere brutto-JTD.
0200	Brutto-JTD	Artikel 325v, stk. 1, litra c), artikel 325w, stk. 1, 2 og 5, artikel 325z, stk. 1 og artikel 325ac, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Institutterne indberetter bruttobeløbet for pludselig misligholdelse (brutto-JTD) for den specifikke eksponering.

C 120.05 — DRC. OFR-SAMMENSÆTNING EFTER PORTEFØLJE

Instrukser vedrørende ark (z-akse)

Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
Portefølje	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Her indberettes porteføljens nummer fra bilag V.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Risikoklasse	Artikel 325v, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes den risikoklasse, for hvilken der er indberettet krav vedrørende misligholdelsesrisiko i kolonne 0030 og 0040. Her angives én af følgende instrumenttyper: (a) »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner« (b) »securitiseringspositioner, som ikke indgår i ACTP« (c) »securitiseringspositioner, som indgår i ACTP«.
0020	Undergruppe1	Artikel 325y, stk. 3, artikel 325aa, stk. 4, og artikel 325ad, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Her angives undergruppen. Hvis den risikoklasse, der indberettes i kolonne 0010, svarer til »instrumenter, som ikke er securitiseringspositioner«, angives ét af følgende: (a) »selskaber« (b) »stater« (c) »lokale myndigheder/kommunale myndigheder«.

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			Hvis den risikoklasse, der er indberettet i kolonne 0010, i stedet svarer til »securitiseringspositioner, som ikke indgår i ACTP«, angives ét af følgende: (d) »ABCP — Asien« (e) »ABCP — Europa« (f) »ABCP — Nordamerika« (g) »ABCP — Resten af verden« (h) »Billån/-leasingkontrakter — Asien« (i) »Billån/-leasingkontrakter — Europa« (j) »Billån/-leasingkontrakter — Nordamerika« (k) »Billån/-leasingkontrakter — Resten af verden« (l) »Strukturerede kreditobligationer af typen »squared« (CDO-squared) — Asien« (m) »Strukturerede kreditobligationer af typen »squared« (CDO-squared) — Europa« (n) »Strukturerede kreditobligationer af typen »squared« (CDO-squared) — Nordamerika« (o) »Strukturerede kreditobligationer af typen »squared« (CDO-squared) — Resten af verden« (p) »Strukturerede låneobligationer (CLO) — Asien« (q) »Strukturerede låneobligationer (CLO) — Europa« (r) »Strukturerede låneobligationer (CLO) — Nordamerika« (s) »Strukturerede låneobligationer (CLO) — Resten af verden« (t) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsejendomslån (CMBS) — Asien« (u) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsejendomslån (CMBS) — Europa« (v) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsejendomslån (CMBS) — Nordamerika« (w) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i erhvervsejendomslån (CMBS) — Resten af verden« (x) »Kreditkort — Asien« (y) »Kreditkort — Europa« (z) »Kreditkort — Nordamerika« (æ) »Kreditkort — Resten af verden« (ø) »Anden detailhandel — Asien« (å) »Anden detailhandel — Europa« (aa) »Anden detailhandel — Nordamerika« (bb) »Anden detailhandel — Resten af verden« (cc) »Anden engroshandel — Asien« (dd) »Anden engroshandel — Europa« (ee) »Anden engroshandel — Nordamerika« (ff) »Anden engroshandel — Resten af verden« (gg) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i boliglån (RMBS) — Asien« (hh) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i boliglån (RMBS) — Europa« (ii) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i boliglån (RMBS) — Nordamerika« (jj) »Værdipapirer med sikkerhedsstillelse i boliglån (RMBS) — Resten af verden« (kk) »Små og mellemstore virksomheder (SMV'er) — Asien« (ll) »Små og mellemstore virksomheder (SMV'er) — Europa« (mm) »Små og mellemstore virksomheder (SMV'er) — Nordamerika« (nn) »Små og mellemstore virksomheder (SMV'er) — Resten af verden« (oo) »Studielån — Asien«

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
			(pp) »Studielån — Europa« (qq) »Studielån — Nordamerika« (rr) »Studielån — Resten af verden«. Hvis den risikoklasse, der indberettes i kolonne 0010, i stedet svarer til »securitiseringspositioner, som indgår i ACTP«, angives følgende svar: »securitiseringer, som indgår i ACTP«.
0030	Undergruppe2	Artikel 325ad, stk. 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Hvis den risikoklasse, der indberettes i kolonne 0010, svarer til »securitiseringspositioner, som indgår i ACTP«, angives navnet på indekset og ellers en tom værdi (NUL).
0040	Kapitalgrundlagskrav (resultater udtrykt i indberetningsvaluta)	Artikel 325y, 325aa og 325ad i forordning (EU) nr. 575/2013	Kapitalgrundlagskrav vedrørende misligholdelsesrisiko indberettes for den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« (som defineret i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b)). Værdierne indberettes i instituttets indberetningsvaluta og udtrykkes med en minimumspræcision på to decimaler.
0050	Indberetningsvaluta		Her indberettes instituttets indberetningsvaluta (den indberettede værdi følger valutabetegnelsen i ISO 4217).
0060	Kapitalgrundlagskrav (resultater udtrykt i EBA's porteføljevaluta)	Bilag V, afsnit 3 og 4, og artikel 325y, 325aa og 325ad i forordning (EU) nr. 575/2013	Værdierne indberettes efter instrukserne for kolonne 0030, men de konverteres til den ECB-valutaspotkurs, der er forbundet med porteføljens valuta, som defineret i nærværende forordnings bilag V, afsnit 3 og 4.

C 120.06 — ASA. OFR

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0010	Porteføljenummer	Afsnit 3, 4 og 5 i bilag V	Her indberettes porteføljens nummer fra bilag V.
0020-0040	Resultater udtrykt i indberetningsvaluta	Afsnit 3 og 4 i bilag V	

Kolonne	Betegnelse	Retsgrundlag	Instrukser
0020	SBM OFR	Artikel 325h i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes for hver portefølje kapitalgrundlagskrav i henhold til følsomhedsmetoden efter den alternative standardmetode for den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« (som beskrevet i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b)).
0030	DRC OFR	Artikel 325v i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes for hver portefølje kapitalgrundlagskrav i henhold til kravet vedrørende misligholdelsesrisiko efter den alternative standardmetode for den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« (som beskrevet i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b)).
0040	RRAO OFR	Artikel 325u i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes for hver portefølje kapitalgrundlagskrav i henhold til kravet vedrørende misligholdelselsesrisiko efter den alternative standardmetode for den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« (som beskrevet i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b)).
0050-0070	Resultater udtrykt i EBA's porteføljevaluta	Afsnit 3 og 4 i bilag V	Hvis instituttets indberetningsvaluta er forskellig fra EBA's porteføljevalutaer, jf. bilag V, afsnit 3 og 4, konverterer institutterne indberetningsvalutaen til ECB's relevante valutaspotkurs.
0050	SBM OFR	Artikel 325h i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes for hver portefølje kapitalgrundlagskrav i henhold til følsomhedsmetoden efter den alternative standardmetode for den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« (som beskrevet i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b)).
0060	DRC OFR	Artikel 325v i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes for hver portefølje kapitalgrundlagskrav i henhold til kravet vedrørende misligholdelselsesrisiko efter den alternative standardmetode for den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« (som beskrevet i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b)).
0070	RRAO OFR	Artikel 325u i forordning (EU) nr. 575/2013	Her indberettes for hver portefølje kapitalgrundlagskrav i henhold til kravet vedrørende misligholdelselsesrisiko efter den alternative standardmetode for den »endelige referencedato for risikomålinger (og for ASA)« (som beskrevet i nærværende forordnings bilag V, afsnit 1, litra b)).

Tabel: vejledning med hensyn til indberetning af skema 106.01 (kolonne 0010) og 120.01 (kolonne 0020)

— Kolonnen »risikoklasse« henviser til artikel 325d, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013. Følgende akronymer anvendes for at betegne risikoklasserne:

a) »GIRR« (almindelig renterisiko)

b) »CSR_NON_SEC« (kreditspændsrisiko (SCR) for ikkesecuritiseringsinstrumenter)

c) »CSR_SEC_NON_ACTP« (kreditspændsrisiko for securitiseringer, der ikke indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR uden for ACTP))

d) »CSR_SEC_ACTP« (kreditspændsrisiko for securitiseringer, der indgår i den alternative korrelationshandelsportefølje (CSR i ACTP))

e) »EQ« (aktierisiko)

f) »CM« (råvarerisiko)

g) »FX« (valutakursrisiko).

— Kolonnen »komponent« henviser til artikel 325e, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013. Følgende akronymer anvendes for at beregne komponenterne i følsomhedsmetoden:

a) »DELTA« (deltarisiko)

b) »VEGA« (vegarisiko)

c) »CURVATURE« (curvaturerisiko).

— Kolonnen »løbetid« henviser til risikofaktorens løbetid, hvis der er defineret risikofaktorer i henhold til angivne toppunkter efter artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p og 325q i forordning (EU) nr. 575/2013. For almindelige vegarenterisikofaktorer som beskrevet i nævnte forordnings artikel 325l, stk. 7, angives der to løbetider, og de adskilles med en bindestreg (f.eks. »0,5 år - 0,5 år«), hvor den første henviser til optionens løbetid og den anden henviser til restløbetiden for optionens underliggende instrument ved udløbsdatoen for optionen.

— Kolonnen »yderligere specifikationer« indeholder en yderligere præcisering af den respektive risikofaktor vedrørende sondringen mellem inflationsrisiko og valutabasisrisikofaktorer i henhold til artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013, sondringen mellem risikofaktorer, der vedrører gældsinstrumenter, og risikofaktorer, der vedrører credit default swaps, i henhold til nævnte forordnings artikel 325m og 325n, sondringen mellem risikofaktorer, der vedrører henholdsvis aktiespotkurs og aktiereporente, i henhold til nævnte forordnings artikel 325o og sondringen mellem den opadgående nettocurvaturerisikoposition for den pågældende risikofaktor (CVRk+) og den nedadgående nettocurvaturerisikoposition for den pågældende risikofaktor (CVRk-) som beskrevet i nævnte forordnings artikel 325g.

Risikoklasse	Komponent	Løbetid	Yderligere specifikation	Risikofaktoridentifikator	Retsgrundlag
CM	DELTA	0 år		CM_D_00.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	0,25 år		CM_D_00.25	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	0,5 år		CM_D_00.50	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	1 år		CM_D_01.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	2 år		CM_D_02.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	3 år		CM_D_03.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	5 år		CM_D_05.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	10 år		CM_D_10.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	15 år		CM_D_15.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	20 år		CM_D_20.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	30 år		CM_D_30.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	VEGA	0,5 år		CM_V_00.50	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	VEGA	1 år		CM_V_01.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	VEGA	3 år		CM_V_03.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	VEGA	5 år		CM_V_05.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	VEGA	10 år		CM_V_10.00	Artikel 325p i forordning (EU) nr. 575/2013
CM	CURVATURE		Opjustering	CM_CU	Artikel 325p og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponent	Løbetid	Yderligere specifikation	Risikofaktoridentifikator	Retsgrundlag
CM	CURVATURE		Nedjustering	CM_CD	Artikel 325p og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 år	Gældsinstrument	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 år	Gældsinstrument	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 år	Gældsinstrument	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 år	Gældsinstrument	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 år	Gældsinstrument	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 år	Credit default swap	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 år	Credit default swap	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 år	Credit default swap	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 år	Credit default swap	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 år	Credit default swap	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 år		CSR_NON_SEC_V_00.50	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	1 år		CSR_NON_SEC_V_01.00	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	3 år		CSR_NON_SEC_V_03.00	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	5 år		CSR_NON_SEC_V_05.00	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	10 år		CSR_NON_SEC_V_10.00	Artikel 325m i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Opjustering	CSR_NON_SEC_CU	Artikel 325m og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponent	Løbetid	Yderligere specifikation	Risikofaktoridentifikator	Retsgrundlag
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Nedjustering	CSR_NON_SEC_CD	Artikel 325m og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 år	Gældsinstrument	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 år	Gældsinstrument	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 år	Gældsinstrument	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 år	Gældsinstrument	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 år	Gældsinstrument	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 år	Credit default swap	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 år	Credit default swap	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 år	Credit default swap	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 år	Credit default swap	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 år	Credit default swap	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 år		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 år		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 år		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 år		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 år		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Opjustering	CSR_SEC_ACTP_CU	Artikel 325n og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponent	Løbetid	Yderligere specifikation	Risikofaktoridentifikator	Retsgrundlag
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Nedjustering	CSR_SEC_ACTP_CD	Artikel 325n og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 år	Gældsinstrument	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_DEBT	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 år	Gældsinstrument	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_DEBT	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 år	Gældsinstrument	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_DEBT	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 år	Gældsinstrument	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_DEBT	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 år	Gældsinstrument	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 år	Credit default swap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 år	Credit default swap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 år	Credit default swap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 år	Credit default swap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 år	Credit default swap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	0,5 år		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	1 år		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	3 år		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	5 år		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	10 år		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Artikel 325n i forordning (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVATURE		Opjustering	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Artikel 325n og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponent	Løbetid	Yderligere specifikation	Risikofaktoridentifikator	Retsgrundlag
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVATURE		Nedjustering	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Artikel 325n og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013
EQ	DELTA		Spotpris	EQ_D_SPOT	Artikel 325o i forordning (EU) nr. 575/2013
EQ	DELTA		Reporente	EQ_D_REPO	Artikel 325o i forordning (EU) nr. 575/2013
EQ	VEGA	0,5 år		EQ_V_00.50	Artikel 325o i forordning (EU) nr. 575/2013
EQ	VEGA	1 år		EQ_V_01.00	Artikel 325o i forordning (EU) nr. 575/2013
EQ	VEGA	3 år		EQ_V_03.00	Artikel 325o i forordning (EU) nr. 575/2013
EQ	VEGA	5 år		EQ_V_05.00	Artikel 325o i forordning (EU) nr. 575/2013
EQ	VEGA	10 år		EQ_V_10.00	Artikel 325o i forordning (EU) nr. 575/2013
EQ	CURVATURE		Opjustering	EQ_CU	Artikel 325o og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013
EQ	CURVATURE		Nedjustering	EQ_CD	Artikel 325o og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013
FX	DELTA			FX_D	Artikel 325q i forordning (EU) nr. 575/2013
FX	VEGA	0,5 år		FX_V_00.50	Artikel 325q i forordning (EU) nr. 575/2013
FX	VEGA	1 år		FX_V_01.00	Artikel 325q i forordning (EU) nr. 575/2013
FX	VEGA	3 år		FX_V_03.00	Artikel 325q i forordning (EU) nr. 575/2013
FX	VEGA	5 år		FX_V_05.00	Artikel 325q i forordning (EU) nr. 575/2013
FX	VEGA	10 år		FX_V_10.00	Artikel 325q i forordning (EU) nr. 575/2013
FX	CURVATURE		Opjustering	FX_CU	Artikel 325q og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponent	Løbetid	Yderligere specifikation	Risikofaktoridentifikator	Retsgrundlag
FX	CURVATURE		Nedjustering	FX_CD	Artikel 325q og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	0,25 år		GIRR_D_00.25	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	0,5 år		GIRR_D_00.50	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	1 år		GIRR_D_01.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	2 år		GIRR_D_02.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	3 år		GIRR_D_03.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	5 år		GIRR_D_05.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	10 år		GIRR_D_10.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	15 år		GIRR_D_15.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	20 år		GIRR_D_20.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	30 år		GIRR_D_30.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Inflation	GIRR_D_INF	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Valutabasis (i EUR)	GIRR_D_CRO_EUR	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Valutabasis (i USD)	GIRR_D_CRO_USD	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 år - 0,5 år		GIRR_V_00.50_00.50	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 år - 0,5 år		GIRR_V_01.00_00.50	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 år - 0,5 år		GIRR_V_03.00_00.50	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Risikoklasse	Komponent	Løbetid	Yderligere specifikation	Risikofaktoridentifikator	Retsgrundlag
GIRR	VEGA	5 år - 0,5 år		GIRR_V_05.00_00.50	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 år - 0,5 år		GIRR_V_10.00_00.50	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 år - 1 år		GIRR_V_00.50_01.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 år - 1 år		GIRR_V_01.00_01.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 år - 1 år		GIRR_V_03.00_01.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 år - 1 år		GIRR_V_05.00_01.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 år - 1 år		GIRR_V_10.00_01.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 år - 3 år		GIRR_V_00.50_03.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 år - 3 år		GIRR_V_01.00_03.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 år - 3 år		GIRR_V_03.00_03.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 år - 3 år		GIRR_V_05.00_03.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 år - 3 år		GIRR_V_10.00_03.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 år - 5 år		GIRR_V_00.50_05.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 år - 5 år		GIRR_V_01.00_05.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 år - 5 år		GIRR_V_03.00_05.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 år - 5 år		GIRR_V_05.00_05.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 år - 5 år		GIRR_V_10.00_05.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponent	Løbetid	Yderligere specifikation	Risikofaktoridentifikator	Retsgrundlag
GIRR	VEGA	0,5 år - 10 år		GIRR_V_00.50_10.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 år - 10 år		GIRR_V_01.00_10.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 år - 10 år		GIRR_V_03.00_10.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 år - 10 år		GIRR_V_05.00_10.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 år - 10 år		GIRR_V_10.00_10.00	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 år	Inflation	GIRR_V_00.50_INF	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 år	Inflation	GIRR_V_01.00_INF	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 år	Inflation	GIRR_V_03.00_INF	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 år	Inflation	GIRR_V_05.00_INF	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 år	Inflation	GIRR_V_10.00_INF	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 år	Valutabasis (i EUR)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 år	Valutabasis (i EUR)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 år	Valutabasis (i EUR)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 år	Valutabasis (i EUR)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 år	Valutabasis (i EUR)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 år	Valutabasis (i USD)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 år	Valutabasis (i USD)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Risikoklasse	Komponent	Løbetid	Yderligere specifikation	Risikofaktoridentifikator	Retsgrundlag
GIRR	VEGA	3 år	Valutabasis (i USD)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 år	Valutabasis (i USD)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 år	Valutabasis (i USD)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Artikel 325l i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Opjustering	GIRR_CU	Artikel 325l og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Nedjustering	GIRR_CD	Artikel 325l og 325g i forordning (EU) nr. 575/2013«

BILAG IV

»BILAG VII

RESULTATER FOR BENCHMARKPORTEFØLJER MED HENBLIK PÅ TILSYN. MARKEDSRISIKO

RESULTATER FOR BENCHMARKPORTEFØLJER. MARKEDSRISIKO			
Skema nr.	**Skemakode**	**Navn på skema/gruppe af skemaer**	**Navn i kortform**
		INDLEDENDE MARKEDSVURDERING (IMV)	
106,1	C 106.00	INDLEDENDE MARKEDSVURDERING OG BEGRUNDELSE FOR UDELADELSE	IMV
106,2	C 106.01	RISIKOFØLSOMHED EFTER INSTRUMENT	FØLSOMHEDER
		VaR, sVaR og PV	
107,1	C 107.01	OPLYSNINGER	VaR og sVaR 1
107,2	C 107.02	RESULTATER UDTRYKT I **EBA'S PORTEFØLJEVALUTA**	VaR og sVaR 2
		TIDSSERIE: GEVINST OG TAB	
108	C 108.00	TIDSSERIE: GEVINST OG TAB	Gevinst og tab
		MODEL FOR FORØGET MISLIGHOLDELSES- OG MIGRERINGSRISIKO (IRC)	
109,1	C 109.01	IRC. OPLYSNINGER OM MODELLEN	IRC 1
109,2	C 109.02	IRC. OPLYSNINGER EFTER PORTEFØLJE	IRC 2
109,3	C 109.03	IRC. VÆRDI EFTER PORTEFØLJE/DATO	IRC 3
		KORRELATIONSHANDEL (CT)	
110,1	C 110.01	KORRELATIONSHANDEL. OPLYSNINGER OM MODELLEN	CT 1
110,2	C 110.02	KORRELATIONSHANDEL. OPLYSNINGER EFTER PORTEFØLJE	CT 2
110,3	C 110.03	KORRELATIONSHANDEL. VÆRDI EFTER PORTEFØLJE/DATO	CT 3
		ASA (SBM & DRC)	
120,1	C 120.01	SBM. RISIKOFØLSOMHEDER EFTER INSTRUMENT/PORTEFØLJE	SBM 1
120,2	C 120.02	SBM. OFR-SAMMENSÆTNING EFTER PORTEFØLJE	SBM 2
120,4	C 120.04	DRC. MARKEDSVÆRDIER OG BRUTTO-JTD EFTER INSTRUMENT/PORTEFØLJE	DRC 1
120,5	C 120.05	DRC. OFR-SAMMENSÆTNING EFTER PORTEFØLJE	DRC 2
120,6	C 120.06	ASA. OFR PR. PORTEFØLJE	ASA OFR

C 106.00 – INDLEDENDE MARKEDSVURDERING OG BEGRUNDELSE FOR UDELADELSE

Instrument-nummer	Instrument modelberegnet for VaR + sVaR (True/False)	Instrument modelberegnet for IRC (TRUE/FALSE)	Instrument modelberegnet for korrelations-handel (TRUE/FALSE)	Begrundelse for udeladelse	Fritekstfelt	Indledende markedsvurde-ring
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 106.01 – RISIKOFØLSOMHED EFTER INSTRUMENT

Instrumentnummer

Risikofaktori-dentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Risikofølsomhed (resultater udtrykt i indberetningsva-luta)	Indberetningsva-luta	Risikofølsomhed (resultater udtrykt i EBA-instrumentets valuta)	Værdiansættel-sesmodel	Definition af følsomheder	Fritekstfelt	Yderligere identifikator2	Kreditkvali-tetskategori
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

C 107.01 – VaR, sVaR og PV. OPLYSNINGER

		Mulighed	Fritekstfelt
		0010	0020
VaR			
0010	**Metode**		
0020	**Beregning af 10-dagesperiode**		

		Mulighed	Fritekstfelt
		0010	0020
0030	**Observationsperiodens længde**		
0040	**Datavægtning**		
0050	**Backtestingtillæg**		
0060	**Obligatorisk VaR-tillæg**		
sVaR			
0070	**Metode**		
0080	**Beregning af 10-dagesperiode**		
0090	**Obligatorisk sVaR-tillæg**		
0100	**Periode for sVaR**		

C 107.02 – VaR og sVaR uden for CTP. RESULTATER UDTRYKT I EBA'S PORTEFØLJEVALUTA

Portefølje

Dato	VaR	sVaR	PV
0010	0020	0030	0040

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 108.00 – TIDSSERIE: GEVINST OG TAB

Portefølje

Dato	**Daglig gevinst og tab (P&L)**
0010	0020

C 109.01 – IRC. OPLYSNINGER OM MODELLEN

		Mulighed	**Fritekstfelt**
Række	**Post**	0010	0020
0010	**Antal modelberegningsfaktorer**		
0020	**Kilde til LGD'er**		

C 109.02 – IRC. OPLYSNINGER EFTER PORTEFØLJE

Portefølje

		Mulighed	Fritekstfelt
Række	**Post**	0010	0020
0010	**Likviditetshorisont**		
0020	**Kilde til PD'er**		
0030	**Kilde til transitionsmatricer**		

C 109.03 – IRC. VÆRDI EFTER PORTEFØLJE/DATO

Portefølje

Dato	IRC
0010	0020

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 110.01 – KORRELATIONSHANDEL. OPLYSNINGER OM MODELLEN

		Mulighed	Fritekstfelt
Række	**Post**	0010	0020
0010	**Antal modelberegningsfaktorer**		
0020	**Kilde til LGD'er**		

C 110.02 – KORRELATIONSHANDEL. OPLYSNINGER EFTER PORTEFØLJE

Portefølje

		Mulighed	Fritekstfelt
Række	**Post**	0010	0020
0010	**Likviditetshorisont**		
0020	**Kilde til PD'er**		
0030	**Kilde til transitionsmatricer**		

C 110.03 – KORRELATIONSHANDEL. ALLE PRISRISICI (APR) EFTER PORTEFØLJE/DATO

Portefølje

Dato	**Alle prisrisici**
0010	0060

C 120.01 – SBM. RISIKOFØLSOMHEDER EFTER INSTRUMENT/PORTEFØLJE

Portefølje

Instrumentnummer	**Risikofaktoridentifikator**	**Undergruppe**	**Yderligere identifikator**	**Risikofølsomhed (resultater udtrykt i indberetningsvaluta)**	**Indberetningsvaluta**	**Risikofølsomhed (Resultater udtrykt i EBA's porteføljevaluta)**	**Risikovægt**	**Yderligere identifikator2**	**Kreditkvalitetskategori**
0010	0020	0030	0040	0060	0070	0080	0090	110	120

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 120.02 – SBM. OFR-SAMMENSÆTNING EFTER PORTEFØLJE

Porteføljе

Risiko-klasse	Risikokomponent	Korrelationsscenarie	Kapitalgrundlagskrav (resultater udtrykt i indberetningsvaluta)	Indberetningsvaluta	Kapitalgrundlagskrav (resultater udtrykt i EBA's porteføljevaluta)	Positioner uden optionalitet, som er omfattet af kapitalgrundlagskrav vedrørende curvaturerisiko.	Metoden med basisvaluta som anvendt for delta- og curvaturevalutarisiko	Opdeling af curvaturerisikokomponenter for valutarisiko efter skala	Indberetning af SBM-valideringsporteføljeresul-tater	Friteks-tfelt
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

C 120.04 – DRC. Markedsværdier og brutto-JTD efter instrument/portefølje

Porteføljе

Heltal

Instrumentnummer	Risikoklasse	Under-gruppe1	Under-gruppe2	Låntager	Kreditkvali-tetskategori	Vægt for misligholdelsesrisiko	Rangorden	Løbetid	Inddrivelsesrate	Kategori	Attachment point (i %)	Detachment point (i %)	Resultater udtrykt i indberetningsvaluta				Resultater udtrykt i EBA'S porteføljevaluta		
													Notionel værdi	P&L + Adjustment	Brutto-JTD	Valuta	Notionel værdi	P&L + Adjustment	Brutto-JTD
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

C 120.05 – DRC. OFR-SAMMENSÆTNING EFTER PORTEFØLJE

Portefølje

Heltal

Risikoklasse	Undergruppe1	Undergruppe2	Kapitalgrundlagskrav (resultater udtrykt i indberetningsvaluta)	Indberetningsvaluta	Kapitalgrundlagskrav (resultater udtrykt i EBA's porteføljevaluta)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 120.06 – ASA. OFR

Porteføljenummer	Resultater udtrykt i indberetningsvaluta			Resultater udtrykt i EBA'S porteføljevaluta		
	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070«

BILAG V

»*BILAG X*

SBM-valideringsporteføljer

Arkets navn	Beskrivelse
Instrumenter	Instrumenter (følsomheder og curvaturerisikopositioner) for SBM-valideringsporteføljer
Porteføljer	SBM-valideringsporteføljer defineret som kombinationer af de instrumenter, der er defineret i dette bilag

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_IRV_b25#	GIRR_V_10.00_10.00	USD				400,00
S_IRV_b24#	GIRR_V_10.00_05.00	USD				200,00
S_IRV_b23#	GIRR_V_10.00_03.00	USD				– 900,00
S_IRV_b22#	GIRR_V_10.00_01.00	USD				950,00
S_IRV_b21#	GIRR_V_10.00_00.50	USD				– 350,00
S_IRV_b20#	GIRR_V_05.00_10.00	USD				1 000,00
S_IRV_b19#	GIRR_V_05.00_05.00	USD				– 300,00
S_IRV_b18#	GIRR_V_05.00_03.00	USD				50,00
S_IRV_b17#	GIRR_V_05.00_01.00	USD				300,00
S_IRV_b16#	GIRR_V_05.00_00.50	USD				– 50,00
S_IRV_e3#	GIRR_V_03.00_CRO_USD	BRL				500,00
S_IRV_b15#	GIRR_V_03.00_10.00	USD				– 400,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_IRV_b14#	GIRR_V_03.00_05.00	USD				700,00
S_IRV_b13#	GIRR_V_03.00_03.00	USD				– 800,00
S_IRV_b12#	GIRR_V_03.00_01.00	USD				700,00
S_IRV_b11#	GIRR_V_03.00_00.50	USD				– 100,00
S_IRV_e2#	GIRR_V_01.00_INF	BRL				750,00
S_IRV_b10#	GIRR_V_01.00_10.00	USD				500,00
S_IRV_b9#	GIRR_V_01.00_05.00	USD				50,00
S_IRV_b8#	GIRR_V_01.00_03.00	USD				– 500,00
S_IRV_b7#	GIRR_V_01.00_01.00	USD				200,00
S_IRV_b6#	GIRR_V_01.00_00.50	USD				900,00
S_IRV_b5#	GIRR_V_00.50_10.00	USD				100,00
S_IRV_c5#	GIRR_V_00.50_10.00	CLP				– 100,00
S_IRV_d5#	GIRR_V_00.50_10.00	EUR				– 2 000,00
S_IRV_b4#	GIRR_V_00.50_05.00	USD				100,00
S_IRV_c4#	GIRR_V_00.50_05.00	CLP				100,00
S_IRV_d4#	GIRR_V_00.50_05.00	EUR				1 500,00
S_IRV_b3#	GIRR_V_00.50_03.00	USD				– 500,00
S_IRV_c3#	GIRR_V_00.50_03.00	CLP				– 300,00
S_IRV_d3#	GIRR_V_00.50_03.00	EUR				1 000,00
S_IRV_b2#	GIRR_V_00.50_01.00	USD				400,00
S_IRV_c2#	GIRR_V_00.50_01.00	CLP				150,00
S_IRV_d2#	GIRR_V_00.50_01.00	EUR				3 750,00
S_IRV_a1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				– 100,00
S_IRV_b1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				700,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_IRV_c1#	GIRR_V_00.50_00.50	CLP				300,00
S_IRV_d1#	GIRR_V_00.50_00.50	EUR				– 4 750,00
S_IRV_e1#	GIRR_V_00.50_00.50	BRL				– 500,00
S_IRD_b11#	GIRR_D_INF	USD				– 50 000,00
S_IRD_d11#	GIRR_D_INF	CLP				95 000,00
S_IRD_e11#	GIRR_D_INF	EUR	DE			– 65 000,00
S_IRD_e13#	GIRR_D_INF	EUR	FR			– 100 000,00
S_IRD_d12#	GIRR_D_CRO_USD	CLP				10 500,00
S_IRD_e12#	GIRR_D_CRO_USD	EUR				– 85 000,00
S_IRD_b12#	GIRR_D_CRO_EUR	USD				– 65 000,00
S_IRD_b10#	GIRR_D_30.00	USD	OIS			– 50 000,00
S_IRD_c10#	GIRR_D_30.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d10#	GIRR_D_30.00	CLP	OIS			15 000,00
S_IRD_e10#	GIRR_D_30.00	EUR	OIS			– 120 000,00
S_IRD_b9#	GIRR_D_20.00	USD	OIS			200 000,00
S_IRD_c9#	GIRR_D_20.00	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d9#	GIRR_D_20.00	CLP	OIS			90 000,00
S_IRD_e9#	GIRR_D_20.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b8#	GIRR_D_15.00	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_c8#	GIRR_D_15.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d8#	GIRR_D_15.00	CLP	OIS			70 000,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_IRD_e8#	GIRR_D_15.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b7#	GIRR_D_10.00	USD	OIS			2 000,00
S_IRD_c7#	GIRR_D_10.00	USD	Libor3m			– 100 000,00
S_IRD_d7#	GIRR_D_10.00	CLP	OIS			– 25 000,00
S_IRD_e7#	GIRR_D_10.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b6#	GIRR_D_05.00	USD	OIS			– 90 000,00
S_IRD_c6#	GIRR_D_05.00	USD	Libor3m			– 35 000,00
S_IRD_d6#	GIRR_D_05.00	CLP	OIS			– 5 000,00
S_IRD_e6#	GIRR_D_05.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b5#	GIRR_D_03.00	USD	OIS			85 000,00
S_IRD_c5#	GIRR_D_03.00	USD	Libor3m			55 000,00
S_IRD_d5#	GIRR_D_03.00	CLP	OIS			– 100 000,00
S_IRD_e5#	GIRR_D_03.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b4#	GIRR_D_02.00	USD	OIS			– 10 000,00
S_IRD_c4#	GIRR_D_02.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d4#	GIRR_D_02.00	CLP	OIS			5 000,00
S_IRD_e4#	GIRR_D_02.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b3#	GIRR_D_01.00	USD	OIS			– 65 000,00
S_IRD_c3#	GIRR_D_01.00	USD	Libor3m			70 000,00
S_IRD_d3#	GIRR_D_01.00	CLP	OIS			10 000,00
S_IRD_e3#	GIRR_D_01.00	EUR	OIS			– 50 000,00
S_IRD_b2#	GIRR_D_00.50	USD	OIS			15 000,00
S_IRD_c2#	GIRR_D_00.50	USD	Libor3m			– 40 000,00
S_IRD_d2#	GIRR_D_00.50	CLP	OIS			45 000,00
S_IRD_e2#	GIRR_D_00.50	EUR	OIS			100,00
S_IRD_a1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_b1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			20 000,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_IRD_c1#	GIRR_D_00.25	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d1#	GIRR_D_00.25	CLP	OIS			– 30 000,00
S_IRD_e1#	GIRR_D_00.25	EUR	OIS			100,00
S_IRD_f1#	GIRR_D_00.25	DKK	OIS			100,00
S_IRC_a1#	GIRR_CU	USD				– 18 466,83
S_IRC_b1#	GIRR_CU	USD				92 233,09
S_IRC_c1#	GIRR_CU	CLP				– 1 270,00
S_IRC_d1#	GIRR_CU	EUR				– 253,12
S_IRC_e1#	GIRR_CU	VND				– 11 950,00
S_IRC_a1#	GIRR_CD	USD				18 647,66
S_IRC_b1#	GIRR_CD	USD				– 93 178,71
S_IRC_c1#	GIRR_CD	CLP				450,00
S_IRC_d1#	GIRR_CD	EUR				– 3 237,08
S_IRC_e1#	GIRR_CD	VND				– 4 030,00
S_FXV_b4#	FX_V_5.00	EUR_CLP				200,00
S_FXV_d4#	FX_V_5.00	CHF_VND				1 500,00
S_FXV_b3#	FX_V_3.00	EUR_CLP				– 400,00
S_FXV_d3#	FX_V_3.00	CHF_VND				1 000,00
S_FXV_b5#	FX_V_10.00	EUR_CLP				150,00
S_FXV_d5#	FX_V_10.00	CHF_VND				– 2 000,00
S_FXV_b2#	FX_V_1.00	EUR_CLP				300,00
S_FXV_d2#	FX_V_1.00	CHF_VND				3 750,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_FXV_a1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				– 100,00
S_FXV_b1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				700,00
S_FXV_c1#	FX_V_0.50	AUD_JPY				450,00
S_FXV_d1#	FX_V_0.50	CHF_VND				– 4 800,00
S_FXD_a1#	FX_D	GBP				5 000,00
S_FXD_b1#	FX_D	GBP				– 8 000,00
S_FXD_c1#	FX_D	CLP				3 000,00
S_FXD_d1#	FX_D	DKK				1 000,00
S_FXD_f1#	FX_D	BGN				1 000,00
S_FXC_a1#	FX_CU	EUR				– 16 037,91
S_FXC_b1#	FX_CU	EUR				80 159,24
S_FXC_c1#	FX_CU	CLP				– 800,00
S_FXC_d1#	FX_CU	JPY				– 1 472,88
S_FXC_e1#	FX_CU	VND				– 3 400,00
S_FXC_f1#	FX_CU	DKK				– 48,61
S_FXC_a1#	FX_CD	EUR				16 162,18
S_FXC_b1#	FX_CD	EUR				– 80 723,02
S_FXC_c1#	FX_CD	CLP				700,00
S_FXC_d1#	FX_CD	JPY				– 1 324,35
S_FXC_e1#	FX_CD	VND				– 2 100,00
S_FXC_f1#	FX_CD	DKK				48,61
S_EQV_a5#	EQ_V_5.00	1	UDSTEDER A			100,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	UDSTEDER AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	UDSTEDER AC			– 50,00
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	UDSTEDER AE			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	UDSTEDER AF			375,00
S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	UDSTEDER B			50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	UDSTEDER F			450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	UDSTEDER J			– 200,00
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	UDSTEDER K			– 825,00
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	UDSTEDER M			– 700,00
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	INDEKS N			850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	INDEKS O			150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	UDSTEDER Y			700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	UDSTEDER A			– 500,00
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	UDSTEDER AA			– 850,00
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	UDSTEDER AD			300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	UDSTEDER AE			– 450,00
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	UDSTEDER AF			– 725,00
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	UDSTEDER B			– 500,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	UDSTEDER F			250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	UDSTEDER J			– 900,00
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	UDSTEDER K			– 975,00
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	INDEKS N			– 1 250,00
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	INDEKS O			100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	UDSTEDER X			– 200,00
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	UDSTEDER Z			– 800,00
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	UDSTEDER A			100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	UDSTEDER AA			– 300,00
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	UDSTEDER AB			– 400,00
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	UDSTEDER AE			– 850,00
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	UDSTEDER AF			525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	UDSTEDER B			500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	UDSTEDER F			600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	UDSTEDER J			150,00
S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	UDSTEDER K			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	INDEKS N			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	INDEKS O			– 200,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	INDEKS Q			– 800,00
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	UDSTEDER A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	UDSTEDER AA			– 400,00
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	UDSTEDER AE			– 250,00
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	UDSTEDER AF			– 1 150,00
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	UDSTEDER B			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	UDSTEDER F			– 750,00
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	UDSTEDER J			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	UDSTEDER K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	INDEKS N			– 800,00
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	INDEKS O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	UDSTEDER A			– 100,00
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	UDSTEDER A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	UDSTEDER AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	UDSTEDER AE			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	UDSTEDER AF			– 300,00
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	UDSTEDER B			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	UDSTEDER C			– 500,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	UDSTEDER D			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	UDSTEDER E			– 800,00
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	UDSTEDER F			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	UDSTEDER G			– 400,00
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	UDSTEDER H			– 50,00
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	UDSTEDER I			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	UDSTEDER J			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	UDSTEDER K			– 300,00
S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	UDSTEDER L			1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	INDEKS N			750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	INDEKS O			– 500,00
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	INDEKS P			40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	UDSTEDER A			16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	UDSTEDER A			– 35 000,00
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	UDSTEDER B			20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	UDSTEDER C			66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	UDSTEDER D			1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	UDSTEDER E			1 100,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	UDSTEDER F			25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	UDSTEDER G			8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	UDSTEDER H			22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	UDSTEDER I			– 12 300,00
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	UDSTEDER J			– 450,00
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	UDSTEDER K			– 143,00
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	UDSTEDER L			– 143,00
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	UDSTEDER M			– 100,00
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	UDSTEDER N			– 100,00
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	UDSTEDER O			– 19 600,00
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	INDEKS Q			1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	INDEKS R			– 40 000,00
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	INDEKS S			– 1 950,00
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	INDEKS S			280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	INDEKS T			3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	UDSTEDER U			– 57,00
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	UDSTEDER V			– 100,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	UDSTEDER A			50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	UDSTEDER AA			79 000,00
S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	UDSTEDER AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	UDSTEDER AC			– 10 000,00
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	UDSTEDER B			– 39 000,00
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	UDSTEDER F			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	UDSTEDER G			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	UDSTEDER K			– 14 250,00
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	UDSTEDER L			– 150 000,00
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	UDSTEDER M			– 85 000,00
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	UDSTEDER N			– 72 000,00
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	UDSTEDER P			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	INDEKS Q			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	INDEKS R			– 40 000,00
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	INDEKS T			– 125 000,00
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	UDSTEDER X			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	UDSTEDER Y			4 800,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_EQD_z1#	EQ_D_REPO	4	UDSTEDER Z			– 15 000,00
S_EQC_a1#	EQ_CU	1	UDSTEDER A			– 37 820,00
S_EQC_a2#	EQ_CU	1	UDSTEDER A			77 655,00
S_EQC_aa1#	EQ_CU	2	UDSTEDER AA			39 300,00
S_EQC_ab1#	EQ_CU	4	UDSTEDER AB			17 262,00
S_EQC_ac1#	EQ_CU	5	UDSTEDER AC			7 139,60
S_EQC_ad1#	EQ_CU	6	UDSTEDER AD			– 3 642,50
S_EQC_ae1#	EQ_CU	7	UDSTEDER AE			3 900,00
S_EQC_af1#	EQ_CU	8	UDSTEDER AF			41 550,00
S_EQC_ag1#	EQ_CU	9	UDSTEDER AG			36 860,00
S_EQC_ah1#	EQ_CU	10	UDSTEDER AH			22 150,00
S_EQC_b1#	EQ_CU	1	UDSTEDER B			20 677,50
S_EQC_c1#	EQ_CU	2	UDSTEDER C			– 31 440,00
S_EQC_d1#	EQ_CU	3	UDSTEDER D			6 238,00
S_EQC_e1#	EQ_CU	4	UDSTEDER E			– 21 605,00
S_EQC_f1#	EQ_CU	5	UDSTEDER F			– 2 850,00
S_EQC_g1#	EQ_CU	6	UDSTEDER G			– 3 642,50

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_EQC_h1#	EQ_CU	7	UDSTEDER H			– 7 800,00
S_EQC_i1#	EQ_CU	8	UDSTEDER I			– 29 550,00
S_EQC_j1#	EQ_CU	9	UDSTEDER J			– 216 320,00
S_EQC_k1#	EQ_CU	10	UDSTEDER K			1 950,00
S_EQC_q1#	EQ_CU	11	UDSTEDER Q			– 19 142,00
S_EQC_r1#	EQ_CU	11	UDSTEDER R			28 713,00
S_EQC_s1#	EQ_CU	3	UDSTEDER S			– 17 025,00
S_EQC_t1#	EQ_CU	12	UDSTEDER T			7 466,67
S_EQC_u1#	EQ_CU	13	UDSTEDER U			11 160,00
S_EQC_v1#	EQ_CU	12	UDSTEDER V			– 39 200,00
S_EQC_w1#	EQ_CU	13	UDSTEDER W			– 58 590,00
S_EQC_y1#	EQ_CU	1	UDSTEDER Y			– 23 930,00
S_EQC_z1#	EQ_CU	1	UDSTEDER Z			– 47 860,00
S_EQC_a1#	EQ_CD	1	UDSTEDER A			39 157,50
S_EQC_a2#	EQ_CD	1	UDSTEDER A			– 80 349,00
S_EQC_aa1#	EQ_CD	2	UDSTEDER AA			– 30 600,00
S_EQC_ab1#	EQ_CD	4	UDSTEDER AB			– 9 826,00
S_EQC_ac1#	EQ_CD	5	UDSTEDER AC			– 5 414,60

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_EQC_ad1#	EQ_CD	6	UDSTEDER AD			2 617,50
S_EQC_ae1#	EQ_CD	7	UDSTEDER AE			– 2 720,00
S_EQC_af1#	EQ_CD	8	UDSTEDER AF			– 28 250,00
S_EQC_ag1#	EQ_CD	9	UDSTEDER AG			– 30 935,00
S_EQC_ah1#	EQ_CD	10	UDSTEDER AH			– 15 025,00
S_EQC_b1#	EQ_CD	1	UDSTEDER B			– 238 910,00
S_EQC_c1#	EQ_CD	2	UDSTEDER C			24 480,00
S_EQC_d1#	EQ_CD	3	UDSTEDER D			– 6 068,00
S_EQC_e1#	EQ_CD	4	UDSTEDER E			12 310,00
S_EQC_f1#	EQ_CD	5	UDSTEDER F			2 160,00
S_EQC_g1#	EQ_CD	6	UDSTEDER G			2 617,50
S_EQC_h1#	EQ_CD	7	UDSTEDER H			5 440,00
S_EQC_i1#	EQ_CD	8	UDSTEDER I			20 050,00
S_EQC_j1#	EQ_CD	9	UDSTEDER J			181 560,00
S_EQC_k1#	EQ_CD	10	UDSTEDER K			– 2 900,00
S_EQC_q1#	EQ_CD	11	UDSTEDER Q			20 052,00
S_EQC_r1#	EQ_CD	11	UDSTEDER R			– 30 078,00
S_EQC_s1#	EQ_CD	3	UDSTEDER S			– 9 435,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	UDSTEDER T			– 7 400,00
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	UDSTEDER U			– 11 040,00
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	UDSTEDER V			38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	UDSTEDER W			57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	UDSTEDER Y			13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	UDSTEDER Z			27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	UDSTEDER A			100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	UDSTEDER B			50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	UDSTEDER C			150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	UDSTEDER HA			– 750,00
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	UDSTEDER A			– 500,00
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	UDSTEDER AB			325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	UDSTEDER B			– 500,00
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	UDSTEDER C			100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	INDEKS V			500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	UDSTEDER A			100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	UDSTEDER B			500,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	UDSTEDER C			– 200,00
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	UDSTEDER A			400,00
S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	UDSTEDER B			200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	UDSTEDER C			400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	UDSTEDER A			– 100,00
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	UDSTEDER A			700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	UDSTEDER B			900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	UDSTEDER C			– 500,00
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	UDSTEDER D			700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	UDSTEDER E			– 800,00
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	UDSTEDER F			700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	UDSTEDER G			– 400,00
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	UDSTEDER H			– 50,00
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	UDSTEDER I			300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	UDSTEDER J			50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	UDSTEDER K			– 300,00
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	UDSTEDER L			1 000,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	UDSTEDER M			– 350,00
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	UDSTEDER N			950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	UDSTEDER O			– 900,00
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	UDSTEDER P			200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	UDSTEDER Q			400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	UDSTEDER R			– 300,00
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEKS S			850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	INDEKS T			– 650,00
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEKS U			– 350,00
S_CND_hb2#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	9	UDSTEDER HB			– 17 000,00
S_CND_t1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	3	UDSTEDER T			– 6 000,00
S_CND_y1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	20	INDEKS Y			9 000,00
S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	UDSTEDER AC			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	UDSTEDER B			– 17 000,00
S_CND_w1#	CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT	10	UDSTEDER W		CQS 1	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	1	UDSTEDER A			– 10 000,00
S_CND_s1#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	3	UDSTEDER S			– 6 000,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	INDEKS X			– 18 500,00
S_CND_a1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	UDSTEDER A			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	UDSTEDER A			– 30 000,00
S_CND_b1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	UDSTEDER B			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	3	UDSTEDER C			– 6 000,00
S_CND_d1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	4	UDSTEDER D			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	5	UDSTEDER E			– 4 000,00
S_CND_f1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	6	UDSTEDER F			– 8 000,00
S_CND_g1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	7	UDSTEDER G			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	8	UDSTEDER H			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	9	UDSTEDER HA			– 23 000,00
S_CND_i1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	10	UDSTEDER I		CQS 2	– 5 000,00
S_CND_j1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	11	UDSTEDER J			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	12	UDSTEDER K			7 000,00
S_CND_l1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	13	UDSTEDER L			– 9 000,00
S_CND_m1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	14	UDSTEDER M			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	15	UDSTEDER N			– 20 000,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CND_o1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	16	UDSTEDER O			5 000,00
S_CND_p1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	17	UDSTEDER P			– 3 000,00
S_CND_q1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	UDSTEDER Q			10 000,00
S_CND_r1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	UDSTEDER R			– 5 000,00
S_CND_a3#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	1	UDSTEDER A			15 000,00
S_CND_ab1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	2	UDSTEDER AB			21 000,00
S_CND_u1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDEKS U			– 32 000,00
S_CND_v1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	20	INDEKS V			– 13 000,00
S_CND_x2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDEKS X			52 500,00
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CU	1	UDSTEDER A			– 2 338,64
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CU	1	UDSTEDER A			35 116,67
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CU	10	UDSTEDER AA		CQS 1	– 1 212,50
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CU	2	UDSTEDER AB1			– 247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CU	1	UDSTEDER B			890,91
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CU	3	UDSTEDER C			– 500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CU	4	UDSTEDER D			415,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CU	5	UDSTEDER E			– 1 050,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CU	6	UDSTEDER F			– 150,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CU	7	UDSTEDER G			– 318,75
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CU	8	UDSTEDER H			– 425,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CU	9	UDSTEDER HB1			– 500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CU	10	UDSTEDER I		CQS 2	– 937,50
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CU	11	UDSTEDER J			– 4 650,00
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CU	12	UDSTEDER K			– 425,00
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CU	13	UDSTEDER L			– 27 660,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CU	14	UDSTEDER M			– 488,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CU	15	UDSTEDER N			13 237,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CU	16	UDSTEDER O			– 1 127,50
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CU	17	UDSTEDER P			– 5 775,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CU	18	UDSTEDER Q			– 7 842,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CU	18	UDSTEDER R			15 684,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CU	4	UDSTEDER S			– 750,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CU	19	UDSTEDER T			3 550,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CU	20	UDSTEDER U			1 660,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CU	19	UDSTEDER V			– 18 637,50

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CU	20	UDSTEDER W			– 8 715,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CU	3	UDSTEDER X			– 500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CU	1	UDSTEDER Y			– 249,95
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CU	1	UDSTEDER Z			– 249,95
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CD	1	UDSTEDER A			2 363,38
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CD	1	UDSTEDER A			– 35 314,65
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CD	10	UDSTEDER AA		CQS 1	1 150,00
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CD	2	UDSTEDER AB1			247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CD	1	UDSTEDER B			– 5 543,43
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CD	3	UDSTEDER C			500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CD	4	UDSTEDER D			– 385,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CD	5	UDSTEDER E			575,00
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CD	6	UDSTEDER F			75,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CD	7	UDSTEDER G			287,50
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CD	8	UDSTEDER H			400,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CD	9	UDSTEDER HB1			500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CD	10	UDSTEDER I		CQS 2	750,00
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CD	11	UDSTEDER J			4 100,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	UDSTEDER K			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	UDSTEDER L			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	UDSTEDER M			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	UDSTEDER N			– 23 437,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	UDSTEDER O			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	UDSTEDER P			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	UDSTEDER Q			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	UDSTEDER R			– 17 504,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	UDSTEDER S			– 250,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	UDSTEDER T			– 3 500,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	UDSTEDER U			– 1 540,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	UDSTEDER V			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	UDSTEDER W			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	UDSTEDER X			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	UDSTEDER Y			– 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	UDSTEDER Z			– 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	KUL			– 300,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	URAN			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	KUL			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	URAN			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	KUL			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	URAN			– 250,00
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	KUL			– 200,00
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	URAN			– 750,00
S_CMV_d1#	CM_V_1.00	2	WTI			– 175,00
S_CMV_f1#	CM_V_1.00	3	FWD ELECTRICITY NE			– 450,00
S_CMV_h1#	CM_V_1.00	4	PANAMAX			– 5 500,00
S_CMV_j1#	CM_V_1.00	5	KOBBER			– 200,00
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	FLYDENDE NATURGAS			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	SØLV			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	MAJS			– 1 000,00
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	VALLE			– 125,00
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	GUMMI			– 50,00
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	KALI			– 1 800,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	KUL			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	KUL			– 350,00
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	URAN			150,00
S_CMV_c1#	CM_V_0.50	2	BRENT			200,00
S_CMV_e1#	CM_V_0.50	3	SPOT ELECTRICITY SE			– 300,00
S_CMV_g1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_i1#	CM_V_0.50	5	STÅL			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	NATURGAS			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	GULD			– 200,00
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	SOJABØNNER			– 750,00
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	FISK			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	KAKAO			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	PLANGLAS			3 000,00
S_CMV_w1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_x1#	CM_V_0.50	4	PANAMAX			15 000,00
S_CMD_p1#	CM_D_30.00	8	MAJS	OKLAHOMA		– 10 000,00
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FWD ELECTRICITY NE	TEXAS		– 4 500,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		– 68 750,00
S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	SØLV	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	VALLE	NEWCASTLE		– 1 250,00
S_CMD_d1#	CM_D_2.00	2	WTI	OKLAHOMA		– 1 750,00
S_CMD_l1#	CM_D_15.00	6	FLYDENDE NATURGAS	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	GUMMI	NEWCASTLE		– 500,00
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	KOBBER	OKLAHOMA		– 2 000,00
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	KALI	NEWCASTLE		– 18 000,00
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	URAN	OKLAHOMA		1 500,00
S_CMD_g1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		– 62 500,00
S_CMD_w1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		– 62 500,00
S_CMD_x1#	CM_D_1.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		187 500,00
S_CMD_a4#	CM_D_0.50	1	KUL	NEWCASTLE		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	KUL	NEWCASTLE		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	KUL	NEWCASTLE		– 3 500,00
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	KUL	LONDON		– 2 000,00
S_CMD_c1#	CM_D_0.00	2	BRENT	LE HAVRE		2 000,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	SPOT ELECTRICITY SE	LONDON		– 3 000,00
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	STÅL	LE HAVRE		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	NATURGAS	LE HAVRE		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	GULD	UK1		– 2 000,00
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	SOJABØNNER	LE HAVRE		– 7 500,00
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	FISK	LONDON		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	KAKAO	LONDON		3 500,00
S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	PLANGLAS	LONDON		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	KUL			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	KUL			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	URAN			6 635,00
S_CMC_c1#	CM_CU	2	BRENT			– 11 600,00
S_CMC_d1#	CM_CU	2	WTI			– 36 900,00
S_CMC_e1#	CM_CU	3	SPOT ELECTRICITY SE			8 563,00
S_CMC_f1#	CM_CU	3	FWD ELECTRICITY NE			– 27 250,00
S_CMC_g1#	CM_CU	4	SUPRAMAX			– 36 880,00
S_CMC_h1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CMC_i1#	CM_CU	5	STÅL			– 5 850,00
S_CMC_j1#	CM_CU	5	KOBBER			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	NATURGAS			– 6 147,50
S_CMC_l1#	CM_CU	6	FLYDENDE NATURGAS			– 6 147,50
S_CMC_m1#	CM_CU	7	GULD			– 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	SØLV			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	SOJABØNNER			– 14 535,00
S_CMC_p1#	CM_CU	8	MAJS			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	FISK			– 19 900,00
S_CMC_r1#	CM_CU	9	VALLE			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	KAKAO			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	GUMMI			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	PLANGLAS			– 13 790,00
S_CMC_v1#	CM_CU	11	KALI			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	MÆLK			– 6 300,00
S_CMC_y1#	CM_CU	1	URAN			– 65 864,00
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CMC_a1#	CM_CD	1	KUL			– 18 260,00
S_CMC_a2#	CM_CD	1	KUL			– 37 630,00
S_CMC_b1#	CM_CD	1	URAN			– 70 460,00
S_CMC_c1#	CM_CD	2	BRENT			8 320,00
S_CMC_d1#	CM_CD	2	WTI			3 550,00
S_CMC_e1#	CM_CD	3	SPOT ELECTRICITY SE			– 8 233,00
S_CMC_f1#	CM_CD	3	FWD ELECTRICITY NE			16 370,00
S_CMC_g1#	CM_CD	4	SUPRAMAX			29 110,00
S_CMC_h1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 15 256,00
S_CMC_i1#	CM_CD	5	STÅL			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	KOBBER			– 10 219,80
S_CMC_k1#	CM_CD	6	NATURGAS			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	FLYDENDE NATURGAS			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	GULD			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	SØLV			– 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	SOJABØNNER			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	MAJS			– 14 735,00

Instrument	Risikofaktoridentifikator	Undergruppe	Yderligere identifikator	Yderligere identifikator2	Kreditkvalitetskategori	Risikofølsomhed
S_CMC_q1#	CM_CD	9	FISK			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	VALLE			– 3 012,00
S_CMC_s1#	CM_CD	10	KAKAO			– 1 415,00
S_CMC_t1#	CM_CD	10	GUMMI			– 7 817,20
S_CMC_u1#	CM_CD	11	PLANGLAS			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	KALI			– 21 300,00
S_CMC_x1#	CM_CD	9	MÆLK			– 4 700,00
S_CMC_y1#	CM_CD	1	URAN			– 66 344,00
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 22 856,00

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
G000	GIRR	DELTA	S_IRD_a1#
G001	GIRR	DELTA	S_IRD_b1#
G002	GIRR	DELTA	S_IRD_b2#
G003	GIRR	DELTA	S_IRD_b3#
G004	GIRR	DELTA	S_IRD_b4#
G005	GIRR	DELTA	S_IRD_b5#
G006	GIRR	DELTA	S_IRD_b6#
G007	GIRR	DELTA	S_IRD_b7#
G008	GIRR	DELTA	S_IRD_b8#
G009	GIRR	DELTA	S_IRD_b9#
G010	GIRR	DELTA	S_IRD_b10#
G011	GIRR	DELTA	S_IRD_b11#
G012	GIRR	DELTA	S_IRD_b12#
G013	GIRR	DELTA	S_IRD_d1#
G014	GIRR	DELTA	S_IRD_d2#
G015	GIRR	DELTA	S_IRD_d3#
G016	GIRR	DELTA	S_IRD_d4#
G017	GIRR	DELTA	S_IRD_d5#
G018	GIRR	DELTA	S_IRD_d6#
G019	GIRR	DELTA	S_IRD_d7#
G020	GIRR	DELTA	S_IRD_d8#
G021	GIRR	DELTA	S_IRD_d9#
G022	GIRR	DELTA	S_IRD_d10#
G023	GIRR	DELTA	S_IRD_d11#
G024	GIRR	DELTA	S_IRD_d12#
G025	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1#
G026	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10#
G027	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_c1#
G028	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10#

Porteføljе	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
G029	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11#
G030	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12#
G031	GIRR	DELTA	S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c6#
G032	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12#
G033	GIRR	DELTA	S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13#
G034	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1#
G035	GIRR	VEGA	S_IRV_b1#
G036	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1#
G037	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5#
G038	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b6# S_IRV_b11# S_IRV_b16# S_IRV_b21#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
G039	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25#
G040	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e2#
G041	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e3#
G042	GIRR	VEGA	S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G043	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5#
G044	GIRR	VEGA	S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G045	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3#
G046	GIRR	CURVATURE	S_IRC_b1#
G047	GIRR	CURVATURE	S_IRC_c1#
G048	GIRR	CURVATURE	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	GIRR	CURVATURE	S_IRC_d1#
G050	GIRR	CURVATURE	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	GIRR	CURVATURE	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	GIRR	CURVATURE	S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G053	GIRR	CURVATURE	S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#

Porteføljе	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
G054	GIRR	ALL	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1# S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3# S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#
G055	GIRR	DELTA	S_IRD_e11# S_IRD_e13#
G056	GIRR	DELTA	S_IRD_e1# S_IRD_f1#
E001	EQ	DELTA	S_EQD_a2#
E002	EQ	DELTA	S_EQD_c1#
E003	EQ	DELTA	S_EQD_d1#
E004	EQ	DELTA	S_EQD_e1#
E005	EQ	DELTA	S_EQD_f1#
E006	EQ	DELTA	S_EQD_h1#
E007	EQ	DELTA	S_EQD_i1#
E008	EQ	DELTA	S_EQD_j1#
E009	EQ	DELTA	S_EQD_k1#
E010	EQ	DELTA	S_EQD_m1#
E011	EQ	DELTA	S_EQD_o1#
E012	EQ	DELTA	S_EQD_q1#
E013	EQ	DELTA	S_EQD_s1#
E014	EQ	DELTA	S_EQD_a3#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
E015	EQ	DELTA	S_EQD_x1#
E016	EQ	DELTA	S_EQD_y1#
E017	EQ	DELTA	S_EQD_z1#
E018	EQ	DELTA	S_EQD_f2#
E019	EQ	DELTA	S_EQD_aa1#
E020	EQ	DELTA	S_EQD_ab1#
E021	EQ	DELTA	S_EQD_ac1#
E022	EQ	DELTA	S_EQD_k2#
E023	EQ	DELTA	S_EQD_m2#
E024	EQ	DELTA	S_EQD_p1#
E025	EQ	DELTA	S_EQD_q2#
E026	EQ	DELTA	S_EQD_t1#
E027	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2#
E028	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_a3#
E029	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b1#
E030	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b2#
E031	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_f2#
E032	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g1#
E033	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g2#
E034	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_k2#
E035	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1#
E036	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l2#
E037	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_m2#
E038	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n1#
E039	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n2#
E040	EQ	DELTA	S_EQD_o1# S_EQD_p1#
E041	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_q2#
E042	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_r1#
E043	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1#
E044	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1# S_EQD_t2#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
E045	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_c1# S_EQD_d1# S_EQD_e1# S_EQD_f1# S_EQD_h1# S_EQD_i1# S_EQD_j1# S_EQD_k1# S_EQD_m1#
E046	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_o1#
E047	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_s1#
E048	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_q1#
E049	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1# S_EQD_m1# S_EQD_n1# S_EQD_q1# S_EQD_s2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E050	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E051	EQ	VEGA	S_EQV_a2#
E052	EQ	VEGA	S_EQV_c1#
E053	EQ	VEGA	S_EQV_d1#
E054	EQ	VEGA	S_EQV_e1#
E055	EQ	VEGA	S_EQV_f1#
E056	EQ	VEGA	S_EQV_g1#
E057	EQ	VEGA	S_EQV_h1#
E058	EQ	VEGA	S_EQV_i1#
E059	EQ	VEGA	S_EQV_j1#
E060	EQ	VEGA	S_EQV_k1#
E061	EQ	VEGA	S_EQV_l1#
E062	EQ	VEGA	S_EQV_n1#
E063	EQ	VEGA	S_EQV_p1#
E064	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2#
E065	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6#
E066	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_b1#
E067	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
E068	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5#
E069	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_aa1#
E070	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5#
E071	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#
E072	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_ae1#
E073	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5#
E074	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5#
E075	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_af1#
E076	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5#
E077	EQ	VEGA	S_EQV_l1# S_EQV_m1#
E078	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5#
E079	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_o1#
E080	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E081	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E082	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_c1# S_EQV_d1# S_EQV_e1# S_EQV_f1# S_EQV_g1# S_EQV_h1# S_EQV_i1# S_EQV_j1# S_EQV_k1#
E083	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_m1#
E084	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_p1#
E085	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_n1#
E086	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1#

Porteføljе	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
E087	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1#
E088	EQ	CURVATURE	S_EQC_b1#
E089	EQ	CURVATURE	S_EQC_c1#
E090	EQ	CURVATURE	S_EQC_d1#
E091	EQ	CURVATURE	S_EQC_e1#
E092	EQ	CURVATURE	S_EQC_f1#
E093	EQ	CURVATURE	S_EQC_g1#
E094	EQ	CURVATURE	S_EQC_h1#
E095	EQ	CURVATURE	S_EQC_i1#
E096	EQ	CURVATURE	S_EQC_j1#
E097	EQ	CURVATURE	S_EQC_k1#
E098	EQ	CURVATURE	S_EQC_q1#
E099	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1#
E100	EQ	CURVATURE	S_EQC_u1#
E101	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	CURVATURE	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	CURVATURE	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	CURVATURE	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	CURVATURE	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1# S_EQC_v1#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
E108	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E109	EQ	CURVATURE	S_EQC_s1#
E110	EQ	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_c1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_f1# S_EQC_g1# S_EQC_h1# S_EQC_i1# S_EQC_j1# S_EQC_k1#
E111	EQ	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_q1#
E112	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E113	EQ	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_t1#
E114	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1#
E115	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E116	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
E117	EQ	ALL	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1# S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
			S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1# S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
F001	FX	DELTA	S_FXD_b1#
F002	FX	DELTA	S_FXD_c1#
F003	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1#
F005	FX	DELTA	S_FXD_b1# S_FXD_c1#
F007	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1#
F008	FX	VEGA	S_FXV_b1#
F009	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1#
F010	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5#
F011	FX	VEGA	S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F012	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1#
F013	FX	VEGA	S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F014	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
F015	FX	CURVATURE	S_FXC_b1#
F016	FX	CURVATURE	S_FXC_c1#
F017	FX	CURVATURE	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	FX	CURVATURE	S_FXC_d1#
F019	FX	CURVATURE	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	FX	CURVATURE	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	FX	CURVATURE	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	FX	CURVATURE	S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F023	FX	ALL	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1# S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F024	FX	DELTA	S_FXD_d1#
F026	FX	DELTA	S_FXD_f1#
F028	FX	CURVATURE	S_FXC_f1#
N001	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1#
N002	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_c1#
N003	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_d1#
N004	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_e1#
N005	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1#
N006	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_g1#
N007	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_h1#
N008	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_i1#
N009	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_w1#
N010	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1#
N011	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_k1#
N012	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_l1#
N013	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_m1#
N014	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
N015	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_o1#
N016	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_p1#
N017	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1#
N018	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1#
N019	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1#
N020	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2#
N021	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a3#
N022	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a4#
N023	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_a4#
N024	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b1#
N025	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1#
N026	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a4# S_CND_b1#
N027	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b2#
N028	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1# S_CND_r1#
N029	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x2#
N030	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1# S_CND_y1#
N031	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x1# S_CND_x2#
N032	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1#
N033	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N034	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N035	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N036	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N037	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N038	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N039	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N040	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
N041	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N042	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1# S_CND_c1# S_CND_s1# S_CND_t1#
N043	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1#
N044	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2#
N045	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2#
N046	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6#
N047	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_b1#
N048	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5#
N049	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_q1# S_CNV_r1#
N050	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_s1# S_CNV_u1#
N051	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_t1# S_CNV_v1#
N052	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N053	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1#
N054	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N055	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N056	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N057	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N058	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N059	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
N060	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N061	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N062	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N063	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_b4# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N064	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1#
N065	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_h1#
N072	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_p1#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
N081	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1#
N092	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N093	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N094	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N095	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N096	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N097	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N098	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N099	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N100	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
N103	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#
N104	CSR_NON_SEC	ALL	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1# S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1# S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
N104(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_ab1#
N105(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_hb1#
N106(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_ab1#
N107(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_hb1#
C001	CM	DELTA	S_CMD_a2#
C002	CM	DELTA	S_CMD_c1#
C003	CM	DELTA	S_CMD_e1#
C004	CM	DELTA	S_CMD_g1#
C005	CM	DELTA	S_CMD_i1#
C006	CM	DELTA	S_CMD_k1#
C007	CM	DELTA	S_CMD_m1#
C008	CM	DELTA	S_CMD_o1#
C009	CM	DELTA	S_CMD_q1#
C010	CM	DELTA	S_CMD_s1#
C011	CM	DELTA	S_CMD_u1#
C012	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2#
C013	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a3#
C014	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a4#
C015	CM	DELTA	S_CMD_a3# S_CMD_a4#
C016	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_b1#
C017	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1#
C018	CM	DELTA	S_CMD_e1# S_CMD_f1#
C019	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1#
C020	CM	DELTA	S_CMD_i1# S_CMD_j1#
C021	CM	DELTA	S_CMD_k1# S_CMD_l1#
C022	CM	DELTA	S_CMD_m1# S_CMD_n1#
C023	CM	DELTA	S_CMD_o1# S_CMD_p1#
C024	CM	DELTA	S_CMD_q1# S_CMD_r1#
C025	CM	DELTA	S_CMD_s1# S_CMD_t1#
C026	CM	DELTA	S_CMD_u1# S_CMD_v1#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
C027	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C028	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_c1# S_CMD_e1# S_CMD_g1# S_CMD_i1# S_CMD_k1# S_CMD_m1# S_CMD_o1# S_CMD_q1# S_CMD_s1#
C029	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_u1#
C030	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C031	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C032	CM	VEGA	S_CMV_a2#
C033	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2#
C034	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6#
C035	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5#
C036	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1#
C037	CM	VEGA	S_CMV_e1# S_CMV_f1#
C038	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1#
C039	CM	VEGA	S_CMV_i1# S_CMV_j1#
C040	CM	VEGA	S_CMV_k1# S_CMV_l1#
C041	CM	VEGA	S_CMV_m1# S_CMV_n1#
C042	CM	VEGA	S_CMV_o1# S_CMV_p1#
C043	CM	VEGA	S_CMV_q1# S_CMV_r1#
C044	CM	VEGA	S_CMV_s1# S_CMV_t1#
C045	CM	VEGA	S_CMV_u1# S_CMV_v1#
C046	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C047	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_c1# S_CMV_e1# S_CMV_g1# S_CMV_i1# S_CMV_k1# S_CMV_m1# S_CMV_o1# S_CMV_q1# S_CMV_s1#
C048	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_u1#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
C049	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C050	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C051	CM	CURVATURE	S_CMC_b1#
C052	CM	CURVATURE	S_CMC_c1#
C053	CM	CURVATURE	S_CMC_e1#
C054	CM	CURVATURE	S_CMC_g1#
C055	CM	CURVATURE	S_CMC_i1#
C056	CM	CURVATURE	S_CMC_k1#
C057	CM	CURVATURE	S_CMC_m1#
C058	CM	CURVATURE	S_CMC_o1#
C059	CM	CURVATURE	S_CMC_q1#
C060	CM	CURVATURE	S_CMC_s1#
C061	CM	CURVATURE	S_CMC_u1#
C062	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	CURVATURE	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	CURVATURE	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	CURVATURE	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	CURVATURE	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	CURVATURE	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	CURVATURE	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	CURVATURE	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	CURVATURE	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	CURVATURE	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	CURVATURE	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	CURVATURE	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	CURVATURE	S_CMC_g1# S_CMC_z1#

Portefølje	Risikoklasse	Komponent	Instrumenter
C076	CM	CURVATURE	S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_e1# S_CMC_g1# S_CMC_i1# S_CMC_k1# S_CMC_m1# S_CMC_o1# S_CMC_q1# S_CMC_s1#
C077	CM	CURVATURE	S_CMC_a2# S_CMC_u1#
C078	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1#
C079	CM	CURVATURE	S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C080	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#
C081	CM	ALL	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#«