Publicatieblad
van de Europese Unie

NL
L-serie

2025/379

12.3.2025

UITVOERINGSVERORDENING (EU) 2025/379 VAN DE COMMISSIE

van 26 februari 2025

tot wijziging van de in Uitvoeringsverordening (EU) 2016/2070 vastgestelde technische uitvoeringsnormen wat betreft in de Unie ten behoeve van de in artikel 78, lid 2, van Richtlijn 2013/36/EU van het Europees Parlement en de Raad bedoelde rapportage te hanteren benchmarkingportefeuilles, rapportagetemplates en rapportage-instructies

(Voor de EER relevante tekst)

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Richtlijn 2013/36/EU van het Europees Parlement en de Raad van 26 juni 2013 betreffende toegang tot het bedrijf van kredietinstellingen en het prudentieel toezicht op kredietinstellingen, tot wijziging van Richtlijn 2002/87/EG en tot intrekking van de Richtlijnen 2006/48/EG en 2006/49/EG ([1]), en met name artikel 78, lid 8, derde alinea,

Overwegende hetgeen volgt:

(1) Krachtens artikel 78, lid 1, van Richtlijn 2013/36/EU moeten instellingen die interne benaderingen gebruiken, met passende intervallen en ten minste jaarlijks, bij hun bevoegde autoriteit de resultaten van de berekeningen van hun risicogewogen posten of eigenvermogensvereisten in het kader van hun interne benaderingen voor in de benchmarkportefeuilles opgenomen blootstellingen of posities indienen, zodat die bevoegde autoriteit de kwaliteit van die interne benaderingen kan beoordelen ("benchmarkingexercitie"). Krachtens artikel 78, lid 3, tweede alinea, van die richtlijn moet de Europese Bankautoriteit ("EBA") een verslag opstellen om de bevoegde autoriteiten bij te staan bij de beoordeling van de kwaliteit van de interne benaderingen van instellingen, op basis van de uitkomsten van de benchmarkingexercitie. De rapportagevereisten voor de benchmarkingexercitie zijn vastgelegd in Uitvoeringsverordening (EU) 2016/2070 van de Commissie ([2]) die diverse malen is gewijzigd. Om de verschuivingen in de focus van de beoordelingen van de bevoegde autoriteiten en in de EBA-verslagen tot uiting te brengen, en in het licht van veranderingen in de wetgeving op het gebied van marktrisico, moeten de benchmarkportefeuilles andermaal worden geactualiseerd, samen met de in die uitvoeringsverordening vastgestelde rapportagevereisten.

(2) Voor het benchmarken van kredietrisico moeten de instructies worden veranderd om het verplichte karakter te specificeren van de rapportage van risicoparameters voor kans op wanbetaling (Probability of Default — "PD") en verlies bij wanbetaling (Loss Given Default — "LGD") wat betreft de mate van conservatisme (margin of conservativeness — "MoC"), de opslagfactor op grond van de regelgeving en de componenten van neergang (DWT), die een bron van variabiliteit in de modellen kunnen zijn. Daarnaast moet worden gespecificeerd dat instellingen de door de bevoegde autoriteit toegekende identificator van de modellen moeten rapporteren, hetgeen de operationalisering van de rapportage van de allocatie van data vereenvoudigt.

(3) Gedelegeerde Verordening (EU) 2024/2795 ([3]) stelde de datum van toepassing van het nieuwe eigenvermogensvereiste voor marktrisico uit. Daarom worden de templates voor de bestaande interne-modellenbenadering niet vervangen bij deze exercitie. Parallel hiermee moeten de templates voor het valideren van de standaardbenadering worden uitgebreid zodat zij aanvullende portefeuilles bevatten ten opzichte van de exercitie van 2024, waarin alleen rente-instrumenten binnen de scope vielen. Een en ander moet zorgen voor adequaat toezicht en een soepele implementatie van de nieuwe standaardbenadering, die wordt gebruikt voor de berekening van de output floor.

([1]) PB L 176 van 27.6.2013, blz. 338, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj.

([2]) Uitvoeringsverordening (EU) 2016/2070 van de Commissie van 14 september 2016 tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen voor sjablonen, definities en IT-oplossingen die door de instellingen moeten worden gebruikt bij de rapportage aan de Europese Bankautoriteit en de bevoegde autoriteiten in overeenstemming met artikel 78, lid 2, van Richtlijn 2013/36/EU van het Europees Parlement en de Raad (PB L 328 van 2.12.2016, blz. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) Gedelegeerde Verordening (EU) 2024/2795 van de Commissie van 24 juli 2024 tot wijziging van Verordening (EU) nr. 575/2013 van het Europees Parlement en de Raad wat betreft de datum van toepassing van de eigenvermogensvereisten voor marktrisico (PB L, 2024/2795, 31.10.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) Uitvoeringsverordening (EU) 2016/2070 moet bijgevolg dienovereenkomstig worden gewijzigd.

(5) Deze verordening is gebaseerd op de ontwerpen van technische uitvoeringsnormen die de EBA bij de Commissie heeft ingediend.

(6) De EBA heeft open publieksconsultaties georganiseerd over de ontwerpen van technische uitvoeringsnormen waarop deze verordening is gebaseerd, heeft de mogelijke kosten en baten ervan geanalyseerd en het advies van de overeenkomstig artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1093/2010 van het Europees Parlement en de Raad [4] opgerichte Stakeholdergroep bankwezen ingewonnen,

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

Artikel 1

Uitvoeringsverordening (EU) 2016/2070 wordt als volgt gewijzigd:

1) Bijlage IV wordt vervangen door de tekst die is opgenomen in bijlage I bij deze verordening.

2) Bijlage V wordt vervangen door de tekst die is opgenomen in bijlage II bij deze verordening.

3) Bijlage VI wordt vervangen door de tekst die is opgenomen in bijlage III bij deze verordening.

4) Bijlage VII wordt vervangen door de tekst die is opgenomen in bijlage IV bij deze verordening.

5) Bijlage X wordt vervangen door de tekst die is opgenomen in bijlage V bij deze verordening.

Artikel 2

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 26 februari 2025.

Voor de Commissie
De voorzitter
Ursula VON DER LEYEN

[4] Verordening (EU) nr. 1093/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Bankautoriteit), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/78/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 12, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

BIJLAGE I

"BIJLAGE IV

RESULTATEN BENCHMARKINGPORTEFEUILLES TEN BEHOEVE VAN TOEZICHT

DEEL I: ALGEMENE INSTRUCTIES 2

DEEL II: INSTRUCTIES MET BETREKKING TOT DE TEMPLATES 3

C 101 – Bijzonderheden over blootstellingen in portefeuilles met een lage kans op wanbetaling per tegenpartij 3

C 102 – Bijzonderheden over blootstellingen in portefeuilles met een lage kans op wanbetaling 7

C 103 – Bijzonderheden over blootstellingen in portefeuilles met een hoge kans op wanbetaling 13

C 105.01 – Definitie van interne modellen 22

C 105.02 – Mapping van interne modellen met portefeuilles 24

C 105.03 – Mapping van interne modellen met landen 25

DEEL I: ALGEMENE INSTRUCTIES

1. Informatie hoeft alleen te worden gerapporteerd voor tegenpartijen en portefeuilles waarbij er op de referentiedatum sprake is van een daadwerkelijke blootstelling in de vorm van ofwel een oorspronkelijke blootstelling of een blootstelling na kredietrisicolimitering. Tegenpartijen en portefeuilles waarvoor er op de referentiedatum geen sprake is van blootstelling, worden niet gerapporteerd.

2. Informatie hoeft alleen te worden gerapporteerd voor de blootstellingen waarvoor de bevoegde autoriteit een intern model voor de berekening van de risicogewogen posten (Risk Weighted Exposure Amounts – "RWA") heeft goedgekeurd. In template C 101 worden geen tegenpartijcodes gerapporteerd die eindigen op "STDA". Voor de overige tegenpartijcodes in template C 101 van bijlage I en voor de benchmarkingportefeuilles bedoeld in de templates C 102 en C 103 worden blootstellingen onder de standaardbenadering en blootstellingen waarvoor de desbetreffende bevoegde autoriteit tijdelijk of permanent gedeeltelijk gebruik van de standaardbenadering heeft toegestaan, uitgesloten.

3. De velden voor het verzamelen van informatie die niet van toepassing is/slecht gedefinieerd is, worden blanco gelaten of met "NIHIL" ingevuld; dit geldt eveneens voor Exposure at Default (EAD)-gewogen hoeveelheden of parameters die niet kunnen worden berekend. Ook datavelden waarvoor geen rapportageverplichting geldt, kunnen blanco worden gelaten of worden ingevuld met "NIHIL". Nulwaarden worden alleen gerapporteerd wanneer het de bedoeling is om voor een hoeveelheid of parameter "nul" te rapporteren. Voor het rapporteren van hoeveelheden of parameters die nul zijn, mag niet "blanco" of "NIHIL" worden ingevuld.

4. Geldbedragen worden op dezelfde wijze gerapporteerd als bij het overeenkomstig Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451 van de Commissie [1] rapporteren voor de berekening van eigenvermogensvereisten op een specifieke referentiedatum.

[1] Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451 van de Commissie van 17 december 2020 tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen voor de toepassing van Verordening (EU) nr. 575/2013 van het Europees Parlement en de Raad wat betreft de rapportage aan de toezichthoudende autoriteit door instellingen en tot intrekking van Uitvoeringsverordening (EU) nr. 680/2014 (PB L 97 van 19.3.2021, blz. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

DEEL II: INSTRUCTIES MET BETREKKING TOT DE TEMPLATES

C 101 – Bijzonderheden over blootstellingen in portefeuilles met een lage kans op wanbetaling per tegenpartij

Blootstellingen uit hoofde van gespecialiseerde kredietverlening worden uitgesloten.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Code tegenpartij	Template C 101, kolom 0010, van bijlage I	De tegenpartijcode van kolom 0010 van template C 101 van bijlage I waarmee de in de steekproefportefeuilles met een lage kans op wanbetaling (Low Default Portfolio – "LDP") opgenomen tegenpartij wordt bepaald, wordt gerapporteerd. Deze code is een identificatiecode van een rij en is uniek voor elke rij in de template.
0020	Blootstellingscategorie	Punt 76 van bijlage II bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	Elke portefeuille wordt in een van de volgende blootstellingscategorieën ondergebracht: a) Centrale banken en centrale overheden; b) Instellingen; c) Ondernemingen – kmo's (midden- en kleinbedrijf); d) Ondernemingen – Gespecialiseerde kredietverlening; e) Ondernemingen – Overige; f) Particulieren en kleine partijen – Zekergesteld door onroerend goed kmo's; g) Particulieren en kleine partijen – Zekergesteld door onroerend goed niet-kmo's; h) Particulieren en kleine partijen – Gekwalificeerde revolverende blootstellingen; i) Particulieren en kleine partijen – Overige kmo's; j) Particulieren en kleine partijen – Overige niet-kmo's; k) Niet van toepassing. "Niet van toepassing" wordt gebruikt wanneer geen van de antwoorden uit de bovenstaande lijst van toepassing is. Dit is het geval wanneer een tegenpartij wordt ingedeeld in meerdere blootstellingsklassen, zonder dat één klasse duidelijk overheerst.
0040	Rating		De rang van de interne ratingklasse die binnen de toepasselijke interne ratingschaal van de instelling aan de tegenpartij is toegewezen, wordt gerapporteerd. Hierbij wordt de numerieke volgorde 1, 2, 3 enz. gevolgd – oplopend van het laagste tot het hoogste risico, met uitsluiting van wanbetalingen met een PD die overeenkomt met 100 %. Wanneer een instelling gebruikmaakt van een continue ratingschaal overeenkomstig artikel 169, lid 3, van Verordening (EU) nr. 575/2013 van het Europees Parlement en de Raad ([2]), worden de in kolom 0005 van template C 08.02 van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451 gerapporteerde ratingklassen gebruikt. Wanneer blootstellingen aan een tegenpartij in meerdere ratingklassen worden ondergebracht overeenkomstig artikel 172, lid 1, punt e), i) of iii), van Verordening (EU) nr. 575/2013, wordt de ratingklasse nul (0) worden gerapporteerd.

([2]) Verordening (EU) nr. 575/2013 van het Europees Parlement en de Raad van 26 juni 2013 betreffende prudentiële vereisten voor kredietinstellingen en beleggingsondernemingen en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012 (PB L 176 van 27.6.2013, blz. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0050	Datum meest recente rating tegenpartij		De datum van de meest recente rating van de tegenpartij wordt gerapporteerd.
0060	PD	Template C 08.01, kolom 0010, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De aan de tegenpartij toegewezen kans op wanbetaling (Probability of Default – "PD") wordt gerapporteerd. De PD is de PD die wordt gebruikt voor de berekening van de RWA, ongerekend het effect van maatregelen overeenkomstig artikel 458 van Verordening (EU) nr. 575/2013. De PD wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1.
0070	Wanbetalingsstatus		De wanbetalingsstatus van de tegenpartij wordt gerapporteerd. Dit is een van de volgende statussen overeenkomstig artikel 178 van Verordening (EU) nr. 575/2013: a) in wanbetaling; b) niet in wanbetaling.
0080	Oorspronkelijke blootstelling vóór toepassing omrekeningsfactoren	Template C 08.01, kolom 0020, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	Gerapporteerd wordt de oorspronkelijke blootstellingswaarde vóór inaanmerkingneming van eventuele waardeaanpassingen, voorzieningen, effecten van kredietrisicolimiteringstechnieken of omrekeningsfactoren.
0090	Blootstelling na substitutie-effect kredietrisicolimitering, vóór toepassing omrekeningsfactoren	Template C 08.01, kolom 0090, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	Het bedrag waarop kredietomrekeningsfactoren ("CCF") worden toegepast om de EAD (kolom 0110) te verkrijgen, wordt gerapporteerd. Hierbij wordt rekening gehouden met kredietrisicolimiteringstechnieken met substitutie-effecten op de blootstelling.
0100	CCF	Artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Het gewogen CCF-gemiddelde wordt gerapporteerd. De wegingsfactoren die worden gebruikt, zijn de bedragen waarop de CCF's worden toegepast om de EAD te verkrijgen. Voor tegenpartijen met faciliteiten die uitsluitend overeenkomen met posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013, wordt het gerapporteerde gewogen CCF-gemiddelde gebaseerd op alle faciliteiten. Voor tegenpartijen met faciliteiten die niet vallen onder de posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013, wordt de CCF blanco gelaten of wordt "NIHIL" ingevuld.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			Voor tegenpartijen met faciliteiten die overeenkomen met posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013 en met faciliteiten die niet vallen onder de posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van die verordening, wordt het gerapporteerde gewogen CCF-gemiddelde uitsluitend gebaseerd op de faciliteiten die overeenkomen met posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013. Met name worden in de berekening geen faciliteiten opgenomen die overeenkomen met posten bedoeld in artikel 166, lid 10, van die verordening. Wanneer de instelling voor de in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013 vermelde posten eigen CCF-schattingen toepast, worden die CCF's gebruikt om het gewogen CCF-gemiddelde te berekenen. Wanneer de instelling voor de posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013 geen eigen CCF-schattingen toepast, worden de in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013 voorgeschreven CCF's gebruikt. De CCF wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1.
0110	EAD	Template C 08.01, kolom 0110, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De blootstellingswaarde wordt gerapporteerd.
0120	Waarde zekerheid	Template C 08.01, kolommen 0150 t/m 0210, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De marktwaarde van de zekerheid wordt gerapporteerd.
0130	Hyp LGD senior ongedekt zonder negatief onderpand	Artikel 161 van Verordening (EU) nr. 575/2013	De hypothetische eigen schattingen van het verlies bij wanbetaling (Loss Given Default – "LGD") die de instelling voor de blootstellingen aan de tegenpartij zou toepassen, worden als volgt gerapporteerd: (a) de omvang van de blootstellingen is dezelfde als voor de in kolom 0150 gerapporteerde LGD-waarde; (b) de blootstellingen zijn senior en ongedekt; (c) er is geen negatieve onderpandclausule voorhanden. Een negatieve onderpandclausule is een clausule waarin staat dat de kredietnemer of schuldemittent geen van zijn activa aan een andere partij in pand zal geven.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0140	Hyp LGD senior ongedekt met negatief onderpand	Artikel 161 van Verordening (EU) nr. 575/2013	De hypothetische eigen LGD-schattingen die de instelling voor de blootstellingen aan de tegenpartij zou toepassen, worden als volgt gerapporteerd: (a) de omvang van de blootstellingen is dezelfde als voor de in kolom 0150 gerapporteerde LGD-waarde; (b) de blootstellingen zijn senior en ongedekt; (c) er is een negatieve onderpandclausule voorhanden. Een negatieve onderpandclausule is een clausule waarin staat dat de kredietnemer of schuldemittent geen van zijn activa aan een andere partij in pand zal geven.
0150	LGD	Template C 08.01, kolommen 0230 en 0240, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	Het EAD-gewogen gemiddelde van de LGD-waarden van de blootstellingen aan de tegenpartij wordt gerapporteerd. Hierbij gaat het om de LGD's die voor de berekening van de RWA worden gebruikt. Met name wanneer de instelling van haar bevoegde autoriteit toestemming heeft gekregen om eigen schattingen van LGD's te gebruiken, worden de LGD's gebaseerd op de eigen schattingen van de instelling; in andere gevallen zijn zij gebaseerd op de voorgeschreven LGD-waarden, rekening houdende met de toepasselijke risicolimitering. LGD's voor grote gereglementeerde entiteiten uit de financiële sector en niet-gereglementeerde financiële entiteiten worden opgenomen. Het effect van maatregelen overeenkomstig artikel 458 van Verordening (EU) nr. 575/2013 wordt niet meegewogen. De LGD wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1.
0160	Looptijd	Template C 08.01, kolom 0250, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De EAD-gewogen looptijd voor de blootstellingen aan de tegenpartij wordt gerapporteerd. Deze wordt uitgedrukt in aantal dagen.
0170	RWA	Template C 08.01, kolom 0260, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De risicogewogen posten na ondersteuningsfactoren (ondersteuningsfactoren voor kmo 's en infrastructuur) worden gerapporteerd. In de RWA posten wordt het effect van potentiële maatregelen overeenkomstig artikel 458 van Verordening (EU) nr. 575/2013 niet meegenomen.

C 102 – Bijzonderheden over blootstellingen in portefeuilles met een lage kans op wanbetaling

Voor in bijlage I bedoelde portefeuilles met een zekerheidsstellingsstatus niet zijnde "Niet van toepassing" mogen de volgende gegevens worden weggelaten wanneer het goedgekeurde model niet de mogelijkheid biedt om aparte LGD-berekeningen te maken voor de zekergestelde en de ongedekte gedeelten van een blootstelling: LGD (kolom 0130), LGD zonder toezichtmaatregelen (kolom 0131), LGD zonder mate van conservatisme (margin of conservatism – "MoC") en toezichtmaatregelen (kolom 0132), LGD zonder MoC, toezichtmaatregelen en neergangcomponent (kolom 0133), verwachte verliespost (kolom 0150) en RWA (kolom 0170).

Voor portefeuilles met de regelgevingsbenadering omschreven als "Criteria voor het onderbrengen van gespecialiseerde kredietverlening" wordt de volgende informatie weggelaten: PD (kolom 0060), PD zonder toezichtmaatregelen (kolom 0061), PD zonder MoC en toezichtmaatregelen (kolom 0062), LGD (kolom 0130), LGD zonder toezichtmaatregelen (kolom 0131), LGD zonder MoC en toezichtmaatregelen (kolom 0132), LGD zonder MoC, toezichtmaatregelen en neergangcomponent (kolom 0133).

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Portefeuille-ID	Template C 102, kolom 0010, van bijlage I	De portefeuille-ID in kolom 0010 van template C 102 van bijlage I waarmee de portefeuille wordt bepaald, wordt gerapporteerd. Deze ID is een identificatiecode van een rij en is uniek voor elke rij in de template. De aan portefeuille-ID's toegewezen blootstellingen zijn niet exclusief: blootstellingen, of delen van blootstellingen, worden gerapporteerd onder elk portefeuille-ID dat van toepassing is.
0040	Aantal debiteuren		Het aantal debiteuren wordt gerapporteerd. Dit aantal is gebaseerd op debiteuren voor wie een strikt positieve blootstellingswaarde wordt gerapporteerd in kolom 0080 of kolom 0090. Wanneer als gevolg van een kredietrisicolimiteringstechniek volledige substitutie wordt toegepast, wordt de oorspronkelijke debiteur toegevoegd aan het "Aantal debiteuren" van zijn oorspronkelijke portefeuille, en wordt de garantiegever toegevoegd aan het "Aantal debiteuren" van de portefeuille van de garantiegever.
0060	PD	Template C 08.01, kolom 0010, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De PD is de PD die wordt gebruikt voor de berekening van de RWA, ongerekend het effect van maatregelen overeenkomstig artikel 458 van Verordening (EU) nr. 575/2013. Voor portefeuilles die aan een afzonderlijke klasse of groep beantwoorden, wordt de aan die specifieke debiteurenklasse of -groep toegekende PD gerapporteerd. Voor portefeuilles die aan een aggregatie van verschillende debiteurenklassen of -groepen beantwoorden, wordt het EAD-gewogen gemiddelde vermeld van de PD's die aan de blootstellingen in de aggregatie zijn toegekend. De PD wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1.
0061	PD zonder toezichtmaatregelen		De PD zonder toezichtmaatregelen is de PD gebaseerd op de bepalingen van de artikelen 179 en 180 van Verordening (EU) nr. 575/2013 met inbegrip van de door de instelling toegevoegde MoC, maar met uitsluiting van door de bevoegde autoriteiten opgelegde maatregelen (multiplicatoren, opslagfactoren, vloeren of soortgelijke maatregelen die de PD rechtstreeks verhogen). Voor portefeuilles die aan een individuele klasse of groep beantwoorden, wordt de PD voor die klasse gerapporteerd met inbegrip van de MoC maar zonder de toezichtmaatregelen. Voor portefeuilles die aan een aggregatie van verschillende debiteurenklassen of -groepen beantwoorden, wordt het EAD-gewogen gemiddelde van de PD's van de respectieve blootstellingen vermeld met inbegrip van de MoC's maar zonder de toezichtmaatregelen. De PD zonder toezichtmaatregelen wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1. Ingeval de instelling niet in staat is de betrokken voorzichtige aanpassingen te isoleren, is deel I, punt 3, van toepassing.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0062	PD zonder MoC en toezichtmaatregelen		De PD zonder MoC en toezichtmaatregelen is de PD die noch de overeenkomstig artikel 179, lid 1, punt f), en artikel 180, lid 1, punt e), van Verordening (EU) nr. 575/2013 door de instelling toegevoegde MoC noch het effect van door de bevoegde autoriteiten opgelegde maatregelen (multiplicatoren, opslagfactoren, vloeren of soortgelijke maatregelen die de PD rechtstreeks verhogen) omvat. Voor portefeuilles die aan een individuele klasse of groep beantwoorden, wordt de PD voor die klasse gerapporteerd zonder de MoC en zonder de toezichtmaatregelen. Voor portefeuilles die aan een aggregatie van verschillende debiteurenklassen of -groepen beantwoorden, wordt het EAD-gewogen gemiddelde van de PD's van de respectieve blootstellingen gerapporteerd zonder de MoC's en zonder de toezichtmaatregelen. De PD zonder MoC en toezichtmaatregelen wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1. Ingeval de instelling niet in staat is de betrokken voorzichtige aanpassingen te isoleren, is deel I, punt 3, van toepassing.
0080	Oorspronkelijke blootstelling vóór toepassing omrekeningsfactoren	Template C 08.01, kolom 0020, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	Gerapporteerd wordt de oorspronkelijke blootstellingswaarde vóór inaanmerkingneming van eventuele waardeaanpassingen, voorzieningen, effecten van kredietrisicolimiteringstechnieken of omrekeningsfactoren.
0090	Blootstelling na substitutie-effect kredietrisicolimitering, vóór toepassing omrekeningsfactoren	Template C 08.01, kolom 0090, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	Het bedrag waarop kredietomrekeningsfactoren ("CCF") worden toegepast om de EAD (kolom 0110) te verkrijgen, wordt gerapporteerd. Hierbij wordt rekening gehouden met kredietrisicolimiteringstechnieken met substitutie-effecten op de blootstelling.
0100	CCF	Artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Het gewogen CCF-gemiddelde wordt gerapporteerd. De wegingsfactoren die worden gebruikt, zijn de bedragen waarop de CCF's worden toegepast om de EAD te verkrijgen. Voor portefeuilles met faciliteiten die uitsluitend overeenkomen met posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013, wordt het gerapporteerde gewogen CCF-gemiddelde gebaseerd op alle faciliteiten. Voor portefeuilles waarvan geen enkele faciliteit onder de posten bedoeld in artikel 166 van Verordening (EU) nr. 575/2013 valt, wordt de CCF blanco gelaten of wordt "NIHIL" ingevuld. Voor portefeuilles die faciliteiten bevatten die overeenkomen met posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013 en met faciliteiten die niet vallen onder de posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van die verordening, wordt het gerapporteerde gewogen CCF-gemiddelde uitsluitend gebaseerd op de faciliteiten die overeenkomen met posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013. Met name worden in de berekening geen faciliteiten opgenomen die

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			overeenkomen met posten bedoeld in artikel 166, lid 10, van die verordening. Wanneer de instelling voor de in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013 vermelde posten eigen CCF-schattingen toepast, worden die CCF's gebruikt om het gewogen CCF-gemiddelde te berekenen. Wanneer de instelling voor de posten bedoeld in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013 geen eigen CCF-schattingen toepast, worden de in artikel 166, lid 8, van Verordening (EU) nr. 575/2013 voorgeschreven CCF's gebruikt. De CCF wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1.
0110	EAD	Template C 08.01, kolom 0110, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De blootstellingswaarde wordt gerapporteerd.
0120	Waarde zekerheid	Template C 08.01, kolommen 0150 t/m 0210, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De marktwaarde van de zekerheid wordt gerapporteerd.
0130	LGD	Template C 08.01, kolommen 0230 en 0240, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	Het EAD-gewogen gemiddelde van de LGD-waarden van de blootstellingen in de desbetreffende portefeuille wordt gerapporteerd. Hierbij gaat het om de LGD's die voor de berekening van de RWA worden gebruikt. Met name wanneer de instelling van haar bevoegde autoriteit toestemming heeft gekregen om eigen schattingen van LGD's te gebruiken, worden de LGD's gebaseerd op de eigen schattingen van instellingen; in andere gevallen zijn zij gebaseerd op de voorgeschreven LGD-waarden, rekening houdende met de toepasselijke risicolimitering. Blootstellingen en de desbetreffende LGD's voor grote gereglementeerde entiteiten uit de financiële sector en niet-gereglementeerde entiteiten uit de financiële sector worden opgenomen. Het effect van maatregelen overeenkomstig artikel 458 van Verordening (EU) nr. 575/2013 wordt niet meegewogen. De LGD wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0131	LGD zonder toezichtmaatregelen		De LGD zonder toezichtmaatregelen is de op de artikelen 179 en 181 van Verordening (EU) nr. 575/2013 gebaseerde LGD met inbegrip van de door de instelling toegevoegde MoC, maar met uitsluiting van door de bevoegde autoriteiten opgelegde maatregelen (multiplicatoren, opslagfactoren, vloeren of soortgelijke maatregelen die de LGD rechtstreeks verhogen). Voor portefeuilles die aan een individuele klasse of groep beantwoorden, wordt de LGD voor die klasse gerapporteerd met inbegrip van de MoC maar zonder de toezichtmaatregelen. Voor portefeuilles die aan een aggregatie van verschillende debiteurenklassen of -groepen beantwoorden, wordt het EAD-gewogen gemiddelde van de LGD's van de respectieve blootstellingen vermeld met inbegrip van de MoC's maar zonder de toezichtmaatregelen. De LGD zonder toezichtmaatregelen wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1. Ingeval de instelling niet in staat is de betrokken voorzichtige aanpassingen te isoleren, is deel I, punt 3, van toepassing.
0132	LGD zonder MoC en zonder toezichtmaatregelen		De LGD zonder MoC en toezichtmaatregelen is de LGD die noch de overeenkomstig artikel 179, lid 1, punt f), en artikel 181 van Verordening (EU) nr. 575/2013 door de instelling toegevoegde MoC noch het effect van door de bevoegde autoriteiten opgelegde maatregelen (multiplicatoren, opslagfactoren, vloeren of soortgelijke maatregelen die de LGD rechtstreeks verhogen) bevat. Voor portefeuilles die aan een individuele klasse of groep beantwoorden, wordt de LGD voor die klasse gerapporteerd zonder de MoC en zonder de toezichtmaatregelen. Voor portefeuilles die aan een aggregatie van verschillende debiteurenklassen of -groepen beantwoorden, wordt het EAD-gewogen gemiddelde van de LGD's van de respectieve blootstellingen gerapporteerd zonder de MoC's en zonder de toezichtmaatregelen. De PD zonder MoC en toezichtmaatregelen wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1. Ingeval de instelling niet in staat is de betrokken voorzichtige aanpassingen te isoleren, is deel I, punt 3, van toepassing.
0133	LGD zonder MoC, toezichtmaatregelen en neergangcomponent		De LGD zonder MoC, toezichtmaatregelen en neergangcomponent is de LGD die noch de overeenkomstig artikel 179, lid 1, punt f), en artikel 181 van Verordening (EU) nr. 575/2013 door de instelling toegevoegde MoC noch het effect van door de bevoegde autoriteiten opgelegde maatregelen (multiplicatoren, opslagfactoren, vloeren of soortgelijke maatregelen die de LGD rechtstreeks verhogen) noch de neergangcomponent als vereist bij artikel 181, lid 1, punt b), van die verordening bevat. Voor portefeuilles die aan een individuele klasse of groep beantwoorden, wordt de LGD voor die klasse gerapporteerd zonder de MoC, de toezichtmaatregelen en de neergangcomponent. Voor portefeuilles die aan een aggregatie van verschillende debiteurenklassen of -groepen beantwoorden, wordt het EAD-gewogen gemiddelde van de LGD's van de respectieve blootstellingen zonder de MoC's, de toezichtmaatregelen en de neergangcomponent gerapporteerd.

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

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			De LGD zonder MoC, toezichtmaatregelen en neergangcomponent wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1. Ingeval de instelling niet in staat is de betrokken voorzichtige aanpassingen te isoleren, is deel I, punt 3, van toepassing.
0140	Looptijd	Template C 08.01, kolom 0250, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De EAD-gewogen looptijd wordt gerapporteerd. Deze wordt uitgedrukt in aantal dagen. Deze informatie wordt niet gerapporteerd voor blootstellingen waarvoor de looptijd niet bij de berekening van de RWA wordt meegenomen. Met name wordt de looptijd niet gerapporteerd voor portefeuilles die blootstellingen vormen van de blootstellingscategorie "Particulieren en kleine partijen".
0150	Verwachte verliespost	Template C 08.01, kolom 0280, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De verwachte verliespost wordt gerapporteerd.
0160	Voorzieningen blootstellingen in wanbetaling	Template C 09.02, kolommen 0050, 0055 en 0060, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De voorzieningen voor blootstellingen in wanbetaling worden gerapporteerd. Deze omvatten alle algemene en specifieke kredietrisicoaanpassingen voor activa in wanbetaling als bedoeld in artikel 110 van Verordening (EU) nr. 575/2013. (Eenmalige) kredietrisicoaanpassingen die een instelling toepast in verband met de veranderingen in de uitvoering van de definitie van wanbetaling (Definition of Default – "DoD"), worden gerapporteerd zoals ze in de databank van de instelling zijn opgenomen.
0170	RWA	Template C 08.01, kolom 0260, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De RWA na ondersteuningsfactoren (ondersteuningsfactoren voor kmo's en infrastructuur) worden gerapporteerd. In de RWA wordt het effect van potentiële maatregelen overeenkomstig artikel 458 van Verordening (EU) nr. 575/2013 niet meegenomen.
0180	RWA gestandaardiseerd	Deel drie, titel II, hoofdstuk 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	"RWA gestandaardiseerd" is het hypothetische RWA-bedrag dat wordt verkregen door op de blootstellingen de standaardbenadering voor het kredietrisico toe te passen in plaats van de IRB-benadering.

C 103 – Bijzonderheden over blootstellingen in portefeuilles met een hoge kans op wanbetaling

Voor in bijlage I bedoelde portefeuilles met een zekerheidsstellingsstatus niet zijnde "Niet van toepassing" mag de volgende informatie worden weggelaten wanneer het goedgekeurde model niet de mogelijkheid biedt om aparte LGD-berekeningen te maken voor de zekergestelde en de ongedekte gedeelten van een blootstelling: LGD (kolom 0130), LGD zonder toezichtmaatregelen (kolom 0131), LGD zonder MoC en toezichtmaatregelen (kolom 0132), LGD zonder MoC, toezichtmaatregelen en neergangcomponent (kolom 0133), Verwachte verliespost (kolom 0150), RWA (kolom 0170), Verliespercentage laatste jaar (kolom 0210) en Verliespercentage laatste 5 jaar (kolom 0220).

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Portefeuille-ID		De portefeuille-ID in template C 103, kolom 0010, van bijlage I waarmee de portefeuille wordt bepaald, wordt gerapporteerd. Deze ID is een identificatiecode van een rij en is uniek voor elke rij in de template. De aan portefeuille-ID's toegewezen blootstellingen zijn niet exclusief: blootstellingen, of delen van blootstellingen, worden gerapporteerd onder elke portefeuille-ID die van toepassing is.
0040	Aantal debiteuren		De instructies voor template C 102, kolom 0040, van bijlage I zijn van toepassing.
0060	PD		De instructies voor template C 102, kolom 0060, van bijlage I zijn van toepassing.
0061	PD zonder toezichtmaatregelen		De instructies voor template C 102, kolom 0061, van bijlage I zijn van toepassing.
0062	PD zonder MoC en toezichtmaatregelen		De instructies voor template C 102, kolom 0062, van bijlage I zijn van toepassing.
0080	Oorspronkelijke blootstelling vóór toepassing omrekenings-factoren		De instructies voor template C 102, kolom 0080, van bijlage I zijn van toepassing.
0090	Blootstelling na substitutie-effect kredietrisicolimitering, vóór toepassing omrekenings-factoren		De instructies voor template C 102, kolom 0090, van bijlage I zijn van toepassing.
0100	CCF		De instructies voor template C 102, kolom 0100, van bijlage I zijn van toepassing.
0110	EAD		De instructies voor template C 102, kolom 0110, van bijlage I zijn van toepassing.
0120	Waarde zekerheid		De instructies voor template C 102, kolom 0120, van bijlage I zijn van toepassing.
0130	LGD		De instructies voor template C 102, kolom 0130, van bijlage I zijn van toepassing.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0131	LGD zonder toezichtmaatregelen		De instructies voor template C 102, kolom 0131, van bijlage I zijn van toepassing.
0132	LGD zonder MoC en zonder toezichtmaatregelen		De instructies voor template C 102, kolom 0132, van bijlage I zijn van toepassing.
0133	LGD zonder MoC, toezichtmaatregelen en neergangcomponent		De instructies voor template C 102, kolom 0133, van bijlage I zijn van toepassing.
0140	Looptijd		De instructies voor template C 102, kolom 0140, van bijlage I zijn van toepassing.
0150	Verwachte verliespost		De instructies voor template C 102, kolom 0150, van bijlage I zijn van toepassing.
0160	Voorzieningen blootstellingen in wanbetaling		De instructies voor template C 102, kolom 0160, van bijlage I zijn van toepassing.
0170	RWA		De instructies voor template C 102, kolom 0170, van bijlage I zijn van toepassing.
0180	RWA gestandaardiseerd		De instructies voor template C 102, kolom 0180, van bijlage I zijn van toepassing.
0190	Wanbetalingsgraad laatste jaar		De wanbetalingsgraad voor het laatste jaar wordt gerapporteerd. Daartoe wordt de wanbetalingsgraad gedefinieerd als de ratio van de volgende waarden: a) de som van de blootstellingen (oorspronkelijke blootstelling, kolom 0080, gemeten op de referentiedatum minus één jaar) die niet in wanbetaling waren precies één jaar vóór de referentiedatum en waarvoor zich tussen de referentiedatum minus één jaar en de referentiedatum een wanbetaling heeft voorgedaan; b) de som van de blootstellingen (oorspronkelijke blootstelling, kolom 0080, gemeten op de referentiedatum minus één jaar) die niet in wanbetaling waren op de referentiedatum minus één jaar. Nieuwe blootstellingen die ontstonden tijdens het jaar vóór de referentiedatum, worden niet meegenomen. Blootstellingen waarvoor wanbetaling heeft plaatsgevonden en die gezuiverd werden tijdens het jaar voorafgaand aan de referentiedatum, worden zowel in de teller als in de noemer opgenomen. Meervoudige wanbetalingen van dezelfde debiteur worden slechts eenmaal opgenomen.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			Deze informatie wordt alleen gerapporteerd voor portefeuille-ID's met betrekking tot blootstellingen ten aanzien waarvan zich geen wanbetaling heeft voorgedaan. Deze wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1. Wanbetalingen en datums van wanbetalingen worden gebruikt zoals deze zijn opgenomen in het kader van de toepassing van de op het tijdstip van de gebeurtenis geldende DoD, d.w.z. een instelling gaat ervan uit dat zich een wanbetaling heeft voorgedaan met betrekking tot de DoD die de instelling toepaste op het moment dat de gebeurtenis werd opgenomen. Met veranderingen in de DoD wordt alleen vanaf hun datum van uitvoering prospectief rekening gehouden; de retroactieve toepassing van veranderingen van de DoD na de gebeurtenis waardoor wanbetaling ontstaat (achterwaartse simulatie), wordt niet gebruikt.
0200	Wanbetalings-graad afgelopen 5 jaar		Gerapporteerd wordt het gewogen gemiddelde van de wanbetalingsgraden waargenomen in de laatste vijf jaar vóór de referentiedatum. Hiervoor geldt de definitie van wanbetalingsgraad uit kolom 0190. De te gebruiken wegingsfactoren zijn de blootstellingen zonder wanbetaling die worden gebruikt om de wanbetalingsgraad in overeenstemming met kolom 0190 te berekenen. Wanneer de instelling geen wanbetalingsgraad moet berekenen voor de afgelopen vijf jaar voorafgaand aan de referentiedatum overeenkomstig artikel 180, lid 1, punt h), of artikel 180, lid 2, punt e), van Verordening (EU) nr. 575/2013, ontwikkelt de instelling een proxy met behulp van de langste reeks historische data waarover zij beschikt uit de periode van ten hoogste vijf jaar voorafgaand aan de referentiedatum, en verstrekt zij aan haar bevoegde autoriteit de documentatie waarin de berekening nader wordt uitgewerkt. Deze informatie wordt alleen gerapporteerd voor portefeuille-ID's met betrekking tot blootstellingen ten aanzien waarvan zich geen wanbetaling heeft voorgedaan. Deze wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1. Wanbetalingen en datums van wanbetalingen worden gebruikt zoals deze zijn opgenomen in het kader van de toepassing van de op het tijdstip van de gebeurtenis geldende DoD, d.w.z. een instelling gaat ervan uit dat zich een wanbetaling heeft voorgedaan met betrekking tot de DoD die de instelling toepaste op het moment dat de gebeurtenis werd opgenomen. Met veranderingen in de DoD wordt alleen vanaf hun datum van uitvoering prospectief rekening gehouden; de retroactieve toepassing van veranderingen van de DoD na de gebeurtenis waardoor wanbetaling ontstaat (achterwaartse simulatie), wordt niet gebruikt.
0210	Verliespercen-tage laatste jaar		Het voor het recentste jaar waargenomen verliespercentage wordt alleen gerapporteerd voor portefeuille-ID's met betrekking tot blootstellingen "niet in wanbetaling" en "in wanbetaling". Voor portefeuilles zonder wanbetaling is het verliespercentage de som van tijdens het jaar voorafgaand aan de referentiedatum toegepaste kredietrisicoaanpassingen en afschrijvingen voor de blootstellingen die precies één jaar vóór de referentiedatum "blootstellingen niet in wanbetaling" waren en waarvoor zich tijdens het jaar voorafgaand aan de referentiedatum wanbetaling heeft voorgedaan, gedeeld door de som van de EAD, gemeten precies één jaar vóór de referentiedatum, van de blootstellingen die niet in wanbetaling waren precies één jaar vóór de referentiedatum en waarvoor zich tijdens het jaar voorafgaand aan de referentiedatum wanbetaling heeft voorgedaan.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			De teller van het verliespercentage omvat alle kredietrisicoaanpassingen en afschrijvingen voor de blootstellingen die in het jaar vóór de referentiedatum in wanbetaling waren, met inbegrip van de kredietrisicoaanpassingen die vóór de datum van wanbetaling waren toegepast. Nieuwe blootstellingen die ontstonden tijdens het jaar vóór de referentiedatum, worden niet meegenomen. Blootstellingen waarvoor wanbetaling heeft plaatsgevonden en die gezuiverd werden tijdens het jaar voorafgaand aan de referentiedatum, worden opgenomen in de noemer van het verliespercentage, terwijl kredietrisicoaanpassingen en afschrijvingen voor die blootstellingen worden meegewogen in de teller van het verliespercentage. Meervoudige wanbetalingen van precies dezelfde debiteur worden slechts eenmaal opgenomen. Voor portefeuilles in wanbetaling wordt bij het verliespercentage rekening gehouden met blootstellingen die precies één jaar voor de referentiedatum in wanbetaling waren. Het is de som van: a) kredietrisicoaanpassingen voor deze blootstellingen één jaar voor de referentiedatum, en b) kredietrisicoaanpassingen en afschrijvingen toegepast tijdens het jaar voorafgaand aan de referentiedatum, gedeeld door de som van de EAD, gemeten precies één jaar vóór de referentiedatum van de desbetreffende blootstellingen. Nieuwe blootstellingen tijdens het jaar vóór de referentiedatum worden niet meegenomen. Blootstellingen die werden gezuiverd tijdens het jaar voorafgaand aan de referentiedatum, worden opgenomen in de noemer van het verliespercentage, terwijl kredietrisicoaanpassingen en afschrijvingen voor die blootstellingen worden opgenomen in de teller van het verliespercentage. Meervoudige wanbetalingen van dezelfde debiteur worden slechts eenmaal opgenomen. Het verliespercentage wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1. Wanbetalingen en datums van wanbetalingen worden gebruikt zoals deze zijn opgenomen in het kader van de toepassing van de op het tijdstip van de gebeurtenis geldende DoD, d.w.z. een instelling gaat ervan uit dat zich een wanbetaling heeft voorgedaan met betrekking tot de DoD die de instelling toepaste op het moment dat de gebeurtenis werd opgenomen. Met veranderingen in de DoD wordt alleen vanaf hun datum van uitvoering prospectief rekening gehouden; de retroactieve toepassing van veranderingen van de DoD na de gebeurtenis waardoor wanbetaling ontstaat (achterwaartse simulatie), wordt niet gebruikt.
0220	Verliespercentage afgelopen 5 jaar		Het EAD-gewogen gemiddelde van de voor de laatste vijf jaar waargenomen verliespercentages wordt alleen gerapporteerd voor portefeuille-ID's met betrekking tot blootstellingen "niet in wanbetaling" en "in wanbetaling". Hiervoor is de definitie van verliespercentage uit kolom 0210 van toepassing. Het verliespercentage voor de afgelopen vijf jaar wordt gebaseerd op de jaarlijkse verliespercentages van de afgelopen vijf jaar indien deze jaarlijkse verliespercentages gedefinieerd zijn naar analogie met de definitie van het verliespercentage van kolom 0210; de jaarlijkse verliespercentages bevatten met name geen additionele veranderingen van kredietrisicoaanpassingen en afschrijvingen die zich na de observatiehorizon (kalenderjaar) van elk jaarlijks verliespercentage hebben voorgedaan. Wanneer de instelling geen data hoeft te gebruiken voor de afgelopen vijf jaar voorafgaand aan de referentiedatum overeenkomstig artikel 181, lid 2, laatste alinea, van Verordening (EU) nr. 575/2013, ontwikkelt zij een proxy met behulp van de langste reeks historische data waarover zij beschikt uit de periode van ten hoogste vijf jaar voorafgaand aan de referentiedatum, en verstrekt zij aan haar bevoegde autoriteit de documentatie waarin de berekening nader wordt uitgewerkt. Het verliespercentage wordt uitgedrukt als een waarde tussen 0 en 1. Wanbetalingen en datums van wanbetalingen worden gebruikt zoals deze zijn opgenomen in het kader van de toepassing van de op het tijdstip van de gebeurtenis geldende DoD, d.w.z. een instelling gaat ervan uit dat zich een wanbetaling heeft voorgedaan met betrekking tot de DoD die de instelling toepaste op het moment dat de gebeurtenis werd opgenomen. Met veranderingen in de DoD wordt alleen vanaf hun datum van uitvoering prospectief rekening gehouden; de retroactieve toepassing van veranderingen van de DoD na de gebeurtenis waardoor wanbetaling ontstaat (achterwaartse simulatie), wordt niet gebruikt.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0250	RWA-		Instellingen berekenen en rapporteren RWA- voor de in bijlage I, template 103, bedoelde portefeuilles met de volgende portefeuille-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- zijn de hypothetische RWA, na ondersteuningsfactoren, die worden verkregen door toepassing van de PD- waarden in plaats van de PD-waarden van de instelling, en dit voor elke blootstelling. De resterende parameters die nodig zijn voor de berekening, blijven ongewijzigd. PD- is gebaseerd op een berekening die voor iedere debiteurenklasse afzonderlijk wordt gemaakt. Hiervoor worden de in kolom 0005 van template C 08.02 van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451 van de Commissie gerapporteerde debiteurenklassen gebruikt (zie voor instructies template C 08.01, kolom 0010, en template C 08.02 van bijlage II bij die verordening). Voor iedere debiteurenklasse is p^- de kleinste positieve waarde die voldoet aan de vergelijking $$p^- + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^- \cdot (1-p^-)}{n}} \geq DR_{1y}$$ waarbij $DR_{1y} > 0$, en $p^- := 0$ waarbij $DR_{1y} = 0$. Hierbij geldt: Φ^{-1} = de inverse functie van de standaard normale (cumulatieve) distributie; q = het op 90 % bepaalde betrouwbaarheidsniveau; DR_{1y} = het gevalsgewogen wanbetalingspercentage van het jaar voorafgaand aan de referentiedatum, d.w.z. het aantal debiteuren dat niet in wanbetaling verkeerde en dat de betrokken debiteurenklasse kreeg toegekend precies één jaar vóór de referentiedatum en dat tijdens het recentste jaar in wanbetaling verkeerde, gedeeld door het aantal debiteuren dat niet in wanbetaling verkeerde en de betrokken debiteurenklasse kreeg toegekend precies één jaar vóór de referentiedatum; n = het aantal debiteuren dat niet in wanbetaling verkeerde en de betrokken debiteurenklasse kreeg toegekend precies één jaar vóór de referentiedatum. Voor iedere debiteur is PD- gelijk aan p^-, waarbij p^- volgens de formule in de vierde subalinea wordt berekend voor de aan de debiteur toegekende debiteurenklasse.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0260	RWA+		Instellingen berekenen en rapporteren RWA+ voor de in bijlage I, template 103, bedoelde portefeuilles met de volgende portefeuille-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+ zijn de hypothetische RWA, na ondersteuningsfactoren, die worden verkregen door toepassing van de PD+ waarden in plaats van de PD-waarden van de instelling, en dit voor elke blootstelling. De resterende parameters die nodig zijn voor de berekening, blijven ongewijzigd. PD+ is gebaseerd op een berekening die voor iedere debiteurenklasse afzonderlijk wordt gemaakt. Hiervoor worden de in kolom 0005 van template C 08.02 van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451 van de Commissie gerapporteerde debiteurenklassen gebruikt (zie voor instructies template C 08.01, kolom 0010, en template C 08.02 van bijlage II bij die verordening). Voor iedere debiteurenklasse is p^+ de grootste positieve waarde die voldoet aan de vergelijking $$p^+ - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^+ \bullet (1-p^+)}{n}} \leq DR_{1y}$$ waarbij: Φ^{-1} = de inverse functie van de standaard normale (cumulatieve) distributie; q = het op 90 % bepaalde betrouwbaarheidsniveau; DR_{1y} = het gevalsgewogen wanbetalingspercentage van het jaar voorafgaand aan de referentiedatum, d.w.z. het aantal debiteuren dat niet in wanbetaling verkeerde en dat de betrokken debiteurenklasse kreeg toegekend precies één jaar vóór de referentiedatum en dat tijdens het recentste jaar in wanbetaling verkeerde, gedeeld door het aantal debiteuren dat niet in wanbetaling verkeerde en de betrokken debiteurenklasse kreeg toegekend precies één jaar vóór de referentiedatum; n = het aantal debiteuren dat niet in wanbetaling verkeerde en de betrokken debiteurenklasse kreeg toegekend precies één jaar vóór de referentiedatum. Voor iedere debiteur is PD+ gelijk aan p^+, waarbij p^+ volgens de formule in de vierde subalinea wordt berekend voor de aan de debiteur toegekende debiteurenklasse.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0270	RWA–		Instellingen berekenen en rapporteren RWA– voor de in bijlage I, template 103, bedoelde portefeuilles met de volgende portefeuille-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– zijn de hypothetische RWA, na ondersteuningsfactoren, die worden verkregen door toepassing van de PD-- waarden in plaats van de PD-waarden van de instelling, en dit voor elke blootstelling. De resterende parameters die nodig zijn voor de berekening, blijven ongewijzigd. PD-- is gebaseerd op een berekening die voor iedere debiteurenklasse afzonderlijk wordt gemaakt. Hiervoor worden de in kolom 0005 van template C 08.02 van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451 van de Commissie gerapporteerde debiteurenklassen gebruikt (zie voor instructies template C 08.01, kolom 0010, en template C 08.02 van bijlage II bij die verordening). Voor iedere debiteurenklasse is p^{--} de kleinste positieve waarde die voldoet aan de vergelijking $$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{--} \cdot (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$ waarbij $DR_{5y} > 0$, en $p^{--} := 0$ waarbij $DR_{5y} = 0$ Hierbij geldt: Φ^{-1} = de inverse functie van de standaard normale (cumulatieve) distributie; q = het op 90 % bepaalde betrouwbaarheidsniveau; DR_{5y} = de wanbetalingsgraad van de laatste vijf jaar voor de debiteurenklasse, berekend als het eenvoudig gemiddelde van vijf gevalsgewogen wanbetalingspercentages op één jaar; n = het aantal debiteuren dat niet in wanbetaling verkeerde en de betrokken debiteurenklasse kreeg toegekend precies één jaar vóór de referentiedatum. Voor iedere debiteur is PD-- gelijk aan p^{--}, waarbij p^{--} volgens de formule in de vierde subalinea wordt berekend voor de aan de debiteur toegekende debiteurenklasse.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0280	RWA++		Instellingen berekenen en rapporteren RWA++ voor de in bijlage I, template 103, bedoelde portefeuilles met de volgende portefeuille-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++ zijn de hypothetische RWA, na ondersteuningsfactoren, die worden verkregen door toepassing van de PD++ waarden in plaats van de PD-waarden van de instelling, en dit voor elke blootstelling. De resterende parameters die nodig zijn voor de berekening, blijven ongewijzigd. PD++ is gebaseerd op een berekening die voor iedere debiteurenklasse afzonderlijk wordt gemaakt. Hiervoor worden de in kolom 0005 van template C 08.02 van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451 van de Commissie gerapporteerde debiteurenklassen gebruikt (zie voor instructies template C 08.01, kolom 0010, en template C 08.02 van bijlage II bij die verordening). Voor iedere debiteurenklasse is p^{++} de grootste positieve waarde die voldoet aan de vergelijking $$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{++} \cdot (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$ waarbij: Φ^{-1} = de inverse functie van de standaard normale (cumulatieve) distributie; q = het op 90 % bepaalde betrouwbaarheidsniveau; DR_{5y} = de wanbetalingsgraad van de laatste vijf jaar voor de debiteurenklasse, berekend als het eenvoudig gemiddelde van vijf gevalsgewogen wanbetalingspercentages op één jaar; n = het aantal debiteuren dat niet in wanbetaling verkeerde en de betrokken debiteurenklasse kreeg toegekend precies één jaar vóór de referentiedatum. Voor iedere debiteur is PD++ gelijk aan p^{++}, waarbij p^{++} volgens de formule in de vierde subalinea wordt berekend voor de aan de debiteur toegekende debiteurenklasse.

C 105.01 – Definitie van interne modellen

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	ID intern model		De instelling rapporteert het door de bevoegde autoriteit toegekende ID van het interne model. Ingeval dit niet beschikbaar is, rapporteert de instelling de ID die zijzelf aan het interne model heeft toegekend. De aan het interne model toegekende ID verwijst op unieke wijze naar een intern model dat door de bevoegde autoriteit is goedgekeurd en wordt gebruikt voor de berekening van de RWA. Dit is een identificatiecode van een rij en is uniek voor elke rij in de template.
0020	Naam model		De modelnaam die de rapporterende instelling aan het interne model heeft toegekend, wordt gerapporteerd.
0030	Risicoparameter IRBA		De risicoparameter bij de IRB-benadering is een van de volgende: a) PD; b) LGD; c) CCF. Voor een intern model voor "Ondernemingen – blootstellingen uit hoofde van gespecialiseerde kredietverlening" uit hoofde van artikel 153, lid 5, van Verordening (EU) nr. 575/2013 ("Criteria voor het onderbrengen van gespecialiseerde kredietverlening") wordt het veld blanco gelaten of wordt "NIHIL" ingevuld.
0040	EAD	Template C 08.01, kolom 0110, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De geaggregeerde blootstellingswaarde van de blootstellingen binnen de scope van het ratingmodel wordt gerapporteerd.
0050	EAD-gewogen gemiddelde wanbetalingsgraad vóór kalibratie		Het EAD-gewogen gemiddelde van de bij de kalibratie van de PD-modellen gebruikte jaarlijkse wanbetalingsgraden wordt gerapporteerd. Deze informatie wordt alleen voor PD-modellen ingevuld. Hiervoor wordt gebruikgemaakt van de bij de kalibratie van de parameters van het model gebruikte data. Indien geen interne data voorhanden zijn en de kalibratie op externe data is gebaseerd, worden de externe data gerapporteerd.
0060	Gevalsgewogen gemiddelde wanbetalingsgraad vóór kalibratie		Het eenvoudig gemiddelde van de bij de kalibratie van de PD-modellen gebruikte jaarlijkse gevalsgewogen wanbetalingsgraden wordt gerapporteerd. Deze informatie wordt alleen voor PD-modellen ingevuld. Hiervoor wordt gebruikgemaakt van de bij de kalibratie van de parameters van het model gebruikte data. Indien geen interne data voorhanden zijn en de kalibratie op externe data is gebaseerd, worden de externe data gerapporteerd.
0070	Langetermijn-PD		De centrale tendens wordt gerapporteerd die de instelling gebruikt bij de kalibratie van de modellen die voorzichtige aanpassingen omvat van het eenvoudig gevalsgewogen gemiddelde van de bij de kalibratie van de PD-modellen gebruikte jaarlijkse wanbetalingsgraden. Deze informatie wordt alleen voor PD-modellen ingevuld.
0080	Percentage gezuiverde activa in wanbetaling		Het percentage gezuiverde activa in wanbetaling is het percentage uitstaande activa in wanbetaling die over een 12-maands periode opnieuw de status "niet in wanbetaling" krijgen. Een instelling die geen zuiveringspercentages berekent voor een bepaald model, berekent een proxy voor zuiveringspercentages, in overeenstemming met de gegeven definitie. De instelling rapporteert het gebruik van een proxy aan de bevoegde autoriteit. Die informatie wordt alleen voor PD-modellen ingevuld.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0090	Inningspercentage niet-gezuiverde geëxecuteerde activa		Het gevalsgewogen gemiddelde inningspercentage voor niet-gezuiverde wanbetalingen opgenomen in de tijdreeksen die de instelling gebruikt voor de kalibratie van de LGD-modellen met betrekking tot niet in wanbetaling zijnde activa, wordt gerapporteerd. Hiervoor wordt gebruikgemaakt van de bij de kalibratie van de parameters van het model gebruikte data. Indien geen interne data voorhanden zijn en de kalibratie op externe data is gebaseerd, worden de externe data gerapporteerd. Een instelling die, als gevolg van een onvolledige inningsprocedure, niet over een specifiek inningspercentage voor niet-gezuiverde wanbetalingen beschikt, berekent een proxy rekening houdende met waargenomen inningen, alsmede de schattingen van inningen bij onvoltooide betalings- en herfinancieringsregelingen. De instelling rapporteert het gebruik van een proxy aan de bevoegde autoriteit. Die informatie wordt alleen voor PD-modellen ingevuld.
0100	Duur inningstermijn niet-gezuiverde geëxecuteerde activa		De gevalsgewogen gemiddelde lengte van de inningstermijn (vanaf de start van de wanbetalingsstatus tot aan de datum van voltooiing van de inningsprocedures) voor de niet-gezuiverde wanbetalingen opgenomen in de tijdreeksen die de instelling gebruikt voor de kalibratie van de LGD-modellen met betrekking tot niet in wanbetaling zijnde activa, wordt gerapporteerd. De gevalsgewogen gemiddelde duur wordt uitgedrukt in aantal dagen. Hiervoor wordt gebruikgemaakt van de bij de kalibratie van de parameters van het model gebruikte data. Indien geen interne data voorhanden zijn en de kalibratie op externe data is gebaseerd, worden de externe data gerapporteerd. Een instelling die, als gevolg van een onvolledige inningsprocedure, niet over een specifieke inningstermijn voor niet-gezuiverde wanbetalingen beschikt, berekent een proxy rekening houdende met de gegeven definitie. De instelling rapporteert het gebruik van een proxy aan de bevoegde autoriteit. Die informatie wordt alleen voor PD-modellen ingevuld.
0110	Gezamenlijk besluit	Artikel 20, lid 2, punt a), van Verordening (EU) nr. 575/2013	De instelling rapporteert of er al dan niet een gezamenlijk besluit over prudentiële vereisten bestaat tussen de consoliderende autoriteit en de autoriteit van het land van ontvangst met betrekking tot de toestemming om de IRB-benadering te gebruiken bij de berekening van de prudentiële vereisten voor de blootstellingen die door de dochterondernemingen van de instellingen in de gerapporteerde benchmarkingportefeuilles worden aangehouden.
0120	Consoliderend toezichthouder	Artikel 20 van Verordening (EU) nr. 575/2013	De ISO-landcode wordt gerapporteerd van het land van herkomst van de bevoegde autoriteit die verantwoordelijk is voor het geconsolideerde toezicht op de instelling die gebruikmaakt van een IRB-benadering.
0130	RWA	Template C 08.01, kolom 0260, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De geaggregeerde RWA na ondersteuningsfactoren (ondersteuningsfactoren voor kmo's en infrastructuur) van de blootstellingen binnen de scope van het ratingmodel worden gerapporteerd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0140	RWA-opslagfactoren		De RWA-opslagfactoren zijn een subpositie ("waarvan") van de RWA (template C 105.01, kolom 0130) en omvatten: a) de RWA die worden opgeteld bij de RWA die worden verkregen door toepassing van de risicoparameter(s) van het model wegens rechtstreeks op de RWA toegepaste additionele interne maatregelen van conservatisme (in voorkomend geval); b) de RWA die worden opgeteld bij de RWA die worden verkregen door toepassing van de risicoparameter(s) van het model wegens rechtstreeks op de RWA toegepaste toezichtmaatregelen (in voorkomend geval). De onder de punten a) en b) genoemde bedragen omvatten geen maatregelen die al tot uiting komen in de PD (kolom 0060 van de templates C 102 en C 103), CCF (kolom 0100 van de templates C 102 en C 103) of LGD (kolom 0130 van de templates C 102 en C 103), maar blijven beperkt tot rechtstreeks op de RWA toegepaste maatregelen, eventueel ter aanvulling van de MoC's en toezichtmaatregelen (multiplicatoren, opslagfactoren, vloeren of soortgelijke maatregelen) die de risicoparameters verhogen. In de RWA-opslagfactoren wordt het effect van potentiële maatregelen ingesteld overeenkomstig artikel 458 van Verordening (EU) nr. 575/2013 niet meegenomen. Ingeval de instelling niet in staat is de betrokken voorzichtige aanpassingen te isoleren, is deel I, punt 3, van toepassing.

C 105.02 – Mapping van interne modellen met portefeuilles

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Portefeuille-ID	Template C102, kolom 0010, en template C103, kolom 0010	De portefeuille-ID waarmee de portefeuille op unieke wijze wordt geïdentificeerd overeenkomstig de tabellen C 102 en 103 van bijlage I, wordt gerapporteerd. De kolommen 0010 en 0020 zijn een samengestelde identificatiecode van een rij en zijn samen uniek voor elke rij in deze template.
0020	ID intern model	Template C 105.01, kolom 0010	De door de rapporterende instelling aan het interne model toegekende ID wordt gerapporteerd. De kolommen 0010 en 0020 zijn een samengestelde identificatiecode van een rij en zijn samen uniek voor elke rij in template C 105.02.
0030	EAD	Template C 08.01, kolom 0110, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De geaggregeerde blootstellingswaarde van de blootstellingen in de door kolom 0010 gedefinieerde portefeuille en binnen de scope van het door kolom 0020 gedefinieerde ratingmodel, wordt gerapporteerd. Wanneer alle transacties van een bepaalde portefeuille volgens één specifiek model worden behandeld, is de blootstellingswaarde gelijk aan het bedrag dat voor dezelfde portefeuille is gerapporteerd in kolom 0110 van template C 102 of C 103, al naargelang.
0040	RWA	Template C 08.01, kolom 0260, van bijlage I bij Uitvoeringsverordening (EU) 2021/451	De geaggregeerde RWA na ondersteuningsfactoren voor de blootstellingen in de door kolom 0010 gedefinieerde portefeuille en binnen de scope van het door kolom 0020 gedefinieerde ratingmodel, worden gerapporteerd. Wanneer alle transacties van een bepaalde portefeuille volgens één specifiek model worden behandeld, is de RWA gelijk aan het bedrag dat voor dezelfde portefeuille is gerapporteerd in kolom 0170 van template C 102 of C 103, al naargelang.

C 105.03 – Mapping van interne modellen met landen

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0005	Rij-ID		Deze code is een identificatiecode van een rij en is uniek voor elke rij in de template. Hierbij wordt de numerieke volgorde 1, 2, 3 enz. gevolgd.
0010	ID intern model	Template C105.01, kolom 0010	De door de rapporterende instelling aan het interne model toegekende ID wordt gerapporteerd. Indien één ID van het interne model met verschillende landen verband houdt, worden afzonderlijke rijen gerapporteerd voor elke combinatie van "ID intern model" en "Locatie instelling". De kolommen 0010 en 0020 zijn een samengestelde identificatiecode van een rij en de combinatie daarvan is uniek voor elke rij in de tabel.
0020	Locatie instelling	Artikel 20 van Verordening (EU) nr. 575/2013	De ISO-landcode wordt gerapporteerd van het land van vestiging van elke dochteronderneming waar de voor elke benchmarkingportefeuille gerapporteerde IRB-blootstellingen worden geboekt, ongeacht of de toezichthouder van het land van ontvangst toestemming heeft gegeven om een IRB-benadering toe te passen."

BIJLAGE II

"BIJLAGE V

INSTRUMENTEN EN PORTEFEUILLES VOOR BENCHMARKING MARKTRISICO

Afdeling 1: Instructies

Afdeling 2: Instrumenten

Afdeling 3: Individuele portefeuilles – Eén instrument

Afdeling 4: Individuele portefeuilles – Multi-instrumenten

Afdeling 5: Geaggregeerde portefeuilles

Afdeling 6: Verdere specificaties voor instrumenten

Afdeling 7: SBM-validatieportefeuilles

Afdeling 1: Instructies

(a) Voor de toepassing van deze bijlage geldt het volgende:

(i) "boekingsdatum": de datum en het tijdstip waarop instellingen de transacties boeken ten behoeve van de benchmarkingexercitie;

(ii) "eerste marktwaardering" (IMV): de tegen marktwaarde gewaardeerde instrumenten uit afdeling 2 van deze bijlage, op IMV-referentiedatum en -tijdstip;

(iii) "IMV-referentiedatum": de datum en het tijdstip waarop instellingen de IMV van de transacties in de benchmarkingportefeuille bepalen;

(iv) "IMV-inleverdatum": de datum waarop instellingen de resultaten van de IMV van de transacties in de benchmarkingportefeuille inleveren;

(v) "VaR": Value at Risk;

(vi) "sVaR": Stressed Value at Risk;

(vii) "IRC": Incremental Risk Charge;

(viii) "CTP": correlatiehandelsportefeuille;

(ix) "APR": All Price Risk berekend overeenkomstig artikel 377, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013;

(x) "Risicomaatstaven" (RM): de waarde van de VaR, sVaR en, voor zover vereist, IRC en APR voor de portefeuilles, overeenkomstig de afdelingen 3, 4 en 5 van deze bijlage, tussen de RM-beginreferentiedatum en de RM-eindreferentiedatum;

(xi) "RM-beginreferentiedatum": de datum waarop instellingen de RM-waarden beginnen te berekenen;

(xii) "RM-eindreferentiedatum": de datum waarop instellingen ophouden de RM-waarden te berekenen;

(xiii) "RM-inleverdatum": de datum waarop instellingen de resultaten van de RM van de transacties in de benchmarkingportefeuille inleveren;

(xiv) "contante waarde" (PV): de tegen marktwaarde gewaardeerde portefeuilles uit afdeling 3 van deze bijlage, op de RM-eindreferentiedatum;

(xv) "ATM": "at the money" in termen van de relatieve positie van de actuele of toekomstige koers van het onderliggend actief van een derivaat ten opzichte van de uitoefenprijs van dat derivaat;

(xvi) "OTM": "out of the money" in termen van de relatieve positie van de actuele of toekomstige koers van een onderliggend actief van een derivaat ten opzichte van de uitoefenprijs van dat derivaat;

(xvii) "ITM": "in the money" in termen van de relatieve positie van de actuele of toekomstige koers van het onderliggend actief van een derivaat ten opzichte van de uitoefenprijs van dat derivaat;

(xviii) "long": "gekocht" en "short": "verkocht";

(xix) "CDS": kredietverzuimswaps;

(xx) bij CDS staat "long" voor "protectie gekocht" en "short" voor "protectie verkocht";

(xxi) "mln": miljoen;

(xxii) "otc": over-the-counter;

(xxiii) "ASA": de alternatieve standaardbenadering als bedoeld in deel drie, titel IV, hoofdstuk 1 bis, afdeling 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013;

(xxiv) "SBM": de op gevoeligheden gebaseerde methode als bedoeld in deel drie, titel IV, hoofdstuk 1 bis, afdeling 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013;

(xxv) "DRC": het eigenvermogensvereiste voor wanbetalingsrisico als bedoeld in deel drie, titel IV, hoofdstuk 1 bis, afdeling 5, van Verordening (EU) nr. 575/2013;

(xxvi) "RRAO": de opslagfactor voor restrisico als bedoeld in deel drie, titel IV, hoofdstuk 1 bis, afdeling 4, van Verordening (EU) nr. 575/2013.

(b) De volgende datums zijn van toepassing voor de "benchmarking"-exercitie:

(i) de boekingsdatum is 30 januari 2025;

(ii) de IMV- (en begin-SBM) referentiedatum is 6 februari 2025 (om 17.30 u CET);

(iii) de IMV- (en begin-SBM en SBM-validatie) inleverdatum is 28 februari 2025;

(iv) de RM-beginreferentiedatum is 2 juni 2025;

(v) de RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum is 13 juni 2025;

(vi) de RM- (en eind-ASA) inleverdatum is 18 juli 2025.

(c) Tenzij in afdeling 2 van deze bijlage uitdrukkelijk anders is bepaald, worden alle posities op de in punt b), i), van deze afdeling genoemde datum geboekt. Zodra posities zijn geboekt, veroudert elke portefeuille voor de duur van de benchmarkingexercitie en wordt deze berekend in de aanname dat de instelling geen maatregelen neemt om de portefeuille op enigerlei wijze te beheren gedurende de gehele periode van de benchmarkingexercitie. Tenzij in de specificaties voor een bepaald instrument uitdrukkelijk anders vermeld, worden de uitoefenprijzen voor optieposities vastgesteld ten opzichte van de koersen voor de onderliggende waarden zoals die zijn waargenomen bij de sluiting van de markt op de boekingsdatum.

(d) Ten behoeve van de eerste marktwaardering (IMV), wordt de waardering van elk instrument bij de bevoegde autoriteit van de instelling tegen de IMV-inleverdatum ingediend. Tegen die datum dient de instelling een toelichting bij de resultaten in, overeenkomstig punt e). De IMV wordt, voor zover mogelijk, verstrekt overeenkomstig de "front office"-waardering van de instelling. Ingeval IMV's niet door de front office van de instelling worden verstrekt, geeft de instelling in de toelichting aan wie de IMV-data source provider is.

(e) De toelichting die instellingen samen met de IMV moeten indienen, bevat voor elk instrument alle volgende elementen:

(i) de risicofactoren die voor het berekenen van de IMV van het instrument zijn gebruikt;

(ii) het prijsmodel dat voor het berekenen van de IMV van het instrument is gebruikt, en een beschrijving van dit prijsmodel;

(iii) de in het VaR-model voor het instrument opgenomen risicofactoren;

(iv) de in het VaR-model opgenomen risicofactoren die ook waarderingsinputs voor de IMV van het instrument zijn;

(v) de specifieke details van het VaR-model voor het instrument;

(vi) beschikbare referentiegegevens voor het instrument in het eigen format van de instelling;

(vii) de in de punten h), i), k), m), n), o), v), w), y), gg) en kk), van deze afdeling bedoelde elementen.

(f) Ten behoeve van punt e), v), wordt elk van de volgende elementen gerapporteerd:

(i) beknopte beschrijvingen van het VaR-model;

(ii) toegepaste herwaarderingsmethoden;

(iii) de voor het modelleren van het rendement toegepaste functionele vormen (zoals absoluut, relatief, andere methoden);

(iv) kwalitatieve informatie over de tijdreeksen die voor het kalibreren van het VaR-model van het instrument zijn gebruikt (zoals bron, normaliseringsmethodologie, gehanteerde subklassen, andere informatie die de instellingen relevant achten om de verstrekte resultaten te verklaren).

(g) De in punt d) bedoelde toelichting wordt geactualiseerd telkens als een waardering opnieuw wordt ingediend en geeft de veranderingen tussen de indieningen van data weer. De toelichting bevat een afdeling met een lijst van alle datums waarop data zijn ingediend en de redenen voor het opnieuw indienen van data.

(h) De risico's van de posities worden berekend zonder rekening te houden met de fundingkosten. In voorkomend geval gebruiken instellingen de overnight rate van de valuta van het instrument als disconteringsvoet. Een zekerheidsovereenkomst wordt geacht voorhanden te zijn voor de in afdeling 2 van deze bijlage genoemde derivateninstrumenten. Wanneer dat niet mogelijk is, worden de redenen daarvoor vermeld in de in punt d) bedoelde toelichting.

(i) Tegenpartijkredietrisico en risico van aanpassing van de kredietwaardering (“CVA”) worden niet in aanmerking genomen bij de waardering van de risico’s van portefeuilles. Wanneer dat niet mogelijk is, worden de redenen daarvoor vermeld in de in punt d) van deze afdeling bedoelde toelichting. Instellingen rapporteren gevallen waarin andere typologieën van waarderingsaanpassingen in de IMV zijn opgenomen, en lichten voor elk financieel instrument de methodologie en de impact daarvan toe in de in punt d) van deze afdeling bedoelde toelichting.

(j) Voor transacties die longposities in CDS omvatten, hanteren instellingen de aanname dat direct een vooruitbetaling wordt gedaan om de positie in te nemen volgens de marktnormen en -conventies. De vervaldatum voor alle CDS stemt overeen met conventionele kwartaaleinddata.

(k) Verdere specificaties die nodig zijn om de voor het berekenen van de CDS-posities vereiste waardering uit te voeren, zijn consistent met de gangbare marktnormen en -conventies en moeten worden verduidelijkt in de in punt d) van deze afdeling bedoelde toelichting.

(l) De vervaldatum borgt dat de transactie het dichtst bij de aangegeven termijn tot de vervaldag ligt, die in overeenstemming met marktnormen en -conventies is gespecificeerd.

(m) Wat betreft niet in afdeling 2 van deze bijlage vermelde nadere gegevens over instrumenten, verschaffen instellingen in de in punt d) van deze afdeling bedoelde toelichting de aannames die zijn gebruikt, met inbegrip van de dagtellingsconventie en de keuze voor een verhandelbaar en liquide instrument, voor zover toegestaan, samen met de resultaten daarvan.

(n) Instellingen die denken dat, naast de in deze afdeling vermelde aannames, nog andere aannames relevant zijn voor de interpretatie van de resultaten van hun exercitie – zoals onder meer het tijdstip van het einde van de werkdag, coupon rolls, mapping met indexen –, verschaffen een beschrijving van die aannames in de in punt d) van deze afdeling bedoelde toelichting.

(o) De in punt d) van deze afdeling bedoelde toelichting bevat verklaringen voor risico’s die niet worden afgedekt door het model voor de in afdeling 2 van deze bijlage vermelde instrumenten.

(p) Alle opties worden behandeld alsof ze otc worden verhandeld, tenzij uitdrukkelijk anders vermeld.

(q) De standaard timingconventies voor otc-opties worden gevolgd. De looptijd voor een “n-maands”-optie wordt uitgedrukt in n maanden. Wanneer opties vervallen op een niet-handelsdag, passen instellingen de vervaldatum per werkdag aan, in overeenstemming met marktnormen en -conventies.

(r) Alle otc-opties worden als volgt behandeld:

  i) als Amerikaans voor single-name aandelen en grondstoffen;

  ii) als Europees voor aandelenindexen, valuta en swaptions.

(s) Alle otc-opties gelden als “naakt” zodat de premie is uitgesloten van de eerste marktwaardering.

(t) Wat CTP’s betreft verschaffen instellingen die toestemming hebben om het APR-model voor CTP’s te gebruiken, nadere gegevens over hun meest relevante aannames, marktnormen en -conventies ten aanzien van de CTP-instrumenten vermeld in afdeling 2 van deze bijlage, met inbegrip van de hedgeratio’s die zij hebben berekend om de CTP-instrumenten op de boekingsdatum CS01-neutraal te maken.

(u) De IMV voor elk instrument wordt gegeven in de in afdeling 2 van deze bijlage voor dat instrument vermelde EBA-instrumentvaluta.

(v) Voor portefeuilles met een of meer instrumenten die luiden in EBA-instrumentvaluta die verschillen van de EBA-portefeuillevaluta, wordt het resultaat tegen de contante wisselkoers van de ECB op de betrokken datum omgezet in de gerapporteerde EBA-portefeuillevaluta. De door omzetting verkregen uitkomst wordt toegelicht in de in punt d) van deze afdeling bedoelde toelichting.

(w) Bij het boeken van posities volgen instellingen de passende marktconventies, tenzij in deze instructies anders wordt vermeld in de beschrijvingen van instrumenten (afdeling 2 van deze bijlage).

(x) Wanneer een instrument, of het onderliggende instrument voor een derivaat, is onderworpen aan een corporate action die van invloed is op de benchmarkingexercitie (zoals een call van de uitgevende instelling, een wanbetaling of vergelijkbare acties), sluiten instellingen dit instrument uit van de exercitie, samen met eventueel daarbij behorende CDS of opties.

(y) Wat een indexreeks betreft, wordt met "on-the-run" de meest liquide en verhandelbare reeks van die index bedoeld die op de markt beschikbaar is. Instellingen lichten in de in punt d) van deze afdeling bedoelde toelichting de door hen gekozen "on-the-run"-reeks toe, samen met de betrokken resultaten.

(z) Tenzij anders bepaald, passen instellingen voor de rente de EU-benchmarkverordening toe om de in afdeling 2 van deze bijlage gespecificeerde instrumenten te boeken. Instellingen vermelden de rente die, zij naast de in afdeling 2 van deze bijlage gespecificeerde rentevoeten, toepassen in de in punt d) van deze instructies bedoelde toelichting.

(aa) Risicomaatstaven voor de in de afdelingen 3, 4 en 5 bedoelde portefeuilles worden, samen met de contante waarde, berekend vanaf de "RM-beginreferentiedatum" tot en met de "RM-eindreferentiedatum". FRTB ASA-risicomaatstaven (SBM, DRC en RRAO) worden berekend voor de "RM-eindreferentiedatum". Instellingen dienen de resultaten van die berekeningen tegen de RM-inleverdatum bij hun bevoegde autoriteit in. De IMV en de SBM worden voor ieder instrument gerapporteerd. Risicomaatstaven, SBM, DRC, RRAO en contante waarde worden, in voorkomend geval, gerapporteerd voor elke portefeuille, zowel individueel als geaggregeerd. SBM, DRC en RRAO worden, in voorkomend geval, ten minste gerapporteerd voor dezelfde portefeuilles waarvoor risicomaatstaven worden gerapporteerd.

(bb) Voor de in afdeling 7 van deze bijlage bedoelde portefeuilles rapporteren instellingen SBM-resultaten en dienen deze overeenkomstig de rapportagedatums van de IMV-indiening in.

(cc) Alleen instellingen die toestemming hebben gekregen om specifieke risico's van schuldinstrumenten te modelleren, rapporteren creditspreadportefeuilles. Voor renteportefeuilles die risico omvatten als onderdeel van bepaalde instrumenten, worden individuele en geaggregeerde portefeuilles gemodelleerd door instellingen die toestemming hebben gekregen om het algemene renterisico te modelleren, alsmede door instellingen die toestemming hebben gekregen om het algemene en het specifieke renterisico te modelleren.

(dd) De resultaten voor zowel individuele als geaggregeerde portefeuilles worden pas ingediend wanneer ook de resultaten van de instrumenten die er deel van uitmaken, worden ingediend.

(ee) In afdeling 2 van deze bijlage (Instrumenten) staat "jaar T" voor "2025" en "jaar T + X" voor "2025 + X", met X gespecificeerd volgens afdeling 2.

(ff) In afdeling 2 van deze bijlage (Instrumenten) stellen instellingen de afloop-/vervaldatum vast op basis van de volgende instructies:

(i) Wanneer de datum wordt vermeld, wordt die specifieke datum gebruikt.

(ii) Wanneer geen datum wordt vermeld, wordt de marktconventie toegepast (voor zover beschikbaar). Indien er bijvoorbeeld een marktconventie is dat de afloop-/vervaldatum de derde vrijdag van de maand is, betekent "juni jaar T" de derde vrijdag van juni van jaar T.

(iii) Aan het einde van de maand betekent dit, wanneer "einde van" is vermeld, de laatste kalenderdag van de maand.

(iv) Voor een vaste periode na de "boekingsdatum", indien de periode als een aantal dagen is vastgesteld, is dit de laatste dag van de periode. Indien de periode is vastgesteld in weken, maanden of jaren, is dit dezelfde dag van de op de boekingsdatum volgende week, de op de boekingsdatum volgende maand of het op de boekingsdatum volgende jaar, of, indien de laatste maand of het laatste jaar van de periode korter is, de laatste dag van die maand of dat jaar. Indien de "boekingsdatum + x periode" een feestdag is, wordt de volgende werkdag gekozen.

(v) Tenzij anders bepaald, worden de volgende aannames gehanteerd: dagtellingsconventie: Act/360, feestdagenkalender: Target2.

(gg) In afdeling 2 van deze bijlage (Instrumenten) gelden, tenzij uitdrukkelijk anders is bepaald, voor alle CDS de volgende vereisten:

(i) Couponfrequentie: per kwartaal;

(ii) Coupon (bp): 100;

(iii) Dagtelling: ACT/360;

(iv) Jaar ISDA-definities: 2014;

(v) Herstructureringsclausule: Modified-Modified Restructuring (MMR);

(vi) Vervaldag: december jaar T+4;

(vii) Type schuld: senior;

(viii) Looptijd: 5 jaar;

(ix) Ingangsdatum als boekingsdatum;

(x) De gebruikte disconteringscurve en het gebruikte inningspercentage worden vermeld in de in punt d) van deze afdeling bedoelde toelichting.

(hh) De IMV van obligatie-instrumenten omvatten de opgelopen rente.

(ii) Instellingen verschaffen de informatie over het tijdstip van de waardering van de contante waarde door het tijdstip te vermelden in de in punt d) van deze afdeling bedoelde toelichting. De waardering van de contante waarde wordt, voor zover mogelijk, berekend aan het einde van de werkdag.

(jj) De risicomaatstaven van de portefeuilles worden in dezelfde valuta berekend als de portefeuillevaluta, ongerekend valutarisico's, ook wat betreft de rapportagevaluta van de instellingen. Het valutarisico wordt alleen meegewogen indien dit intrinsiek in de instrumenten is opgenomen. Indien als onderdeel van de exercitie resultaten in zowel rapportagevaluta als portefeuillevaluta worden gerapporteerd, worden voor de ASA-cijfers de in de rapportagevaluta van de instelling berekende resultaten omgerekend in de EBA-portefeuillevaluta tegen de contante wisselkoers van de ECB die verband houdt met de datum van de berekening. De omrekening in de EBA-portefeuillevaluta houdt geen verandering van de valutarisicofactoren in.

(kk) Wanneer artikel 325 octodecies, lid 7, van Verordening (EU) nr. 575/2013 ("basisvaluta-benadering") van toepassing is, houden instellingen bij het uitvoeren van SBM-berekeningen en het rapporteren van SBM-gevoeligheden rekening met de valutarisicofactoren die voortvloeien uit de toepassing van de basisvalutabenadering. De gerapporteerde waarden worden niet uitgedrukt in de gekozen basisvaluta, maar in de rapportagevaluta van de instellingen door contante omrekening toe te passen op basis van de contante wisselkoers van de ECB die verband houdt met de relevante datum.

Afdeling 2: Instrumenten

Instellingen verstrekken, overeenkomstig de instructies uit afdeling 1 van deze bijlage, IMV voor de volgende financiële instrumenten, waarbij instellingen risicomaatstaven en de contante waarde van de in de afdelingen 3 en 4 gespecificeerde portefeuilles verstrekken:

AANDELEN

101. Long EURO STOXX 50 index (Ticker: FESX) Futures.

Notional: equivalent van de indexwaarde maal 1 000 EUR

Effectenbeurs: Eurex

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

102. Long 10 000 BAYER (Ticker: BAYN GR) aandelen.

Effectenbeurs: Xetra

EBA-instrumentvaluta: EUR

103. Short Futures BAYER (Ticker: BAYN GR).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Effectenbeurs: Eurex

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

104. Short Futures, STELLANTIS (Ticker: STLA FP).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Effectenbeurs: Euronext

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

105. Short Futures, ALLIANZ (Ticker: ALV GR).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Effectenbeurs: Eurex

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

106. Short Futures BARCLAYS (Ticker: BARC LN).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Effectenbeurs: Eurex

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: GBP

107. Short Futures DEUTSCHE BANK (Ticker: DBK GR).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Effectenbeurs: Eurex

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

108. Short Futures CRÉDIT AGRICOLE (Ticker: ACA FP).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Effectenbeurs: Euronext

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

109. Long callopties. Onderliggende waarde BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (1 contract = 100 aandelen).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

110. Short callopties. Onderliggende waarde BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (1 contract = 100 aandelen).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Vervaldatum: december jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

111. Long callopties. Onderliggende waarde PFIZER (Ticker: PFE US) 10 % OTM (1 contract = 100 aandelen).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: USD

112. Long putopties. Onderliggende waarde PFIZER (Ticker: PFE US) 10 % OTM (1 contract = 100 aandelen).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: USD

113. Long callopties. Onderliggende waarde BAYER (Ticker: BAYN GR), 10 % OTM (1 contract = 100 aandelen).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Vervaldatum: december jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

114. Short callopties. Onderliggende waarde BAYER (Ticker: BAYN GR), 10 % OTM (1 contract = 100 aandelen).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

115. Long callopties. Onderliggende waarde AVIVA (Ticker: AV/LN), 10 % OTM (1 contract = 100 aandelen).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Vervaldatum: december jaar T

EBA-instrumentvaluta: GBP

116. Long putopties. Onderliggende waarde AVIVA (Ticker: AV/LN), 10 % OTM (1 contract = 100 aandelen).

Notional: equivalent van de waarde van 10 000 aandelen van het onderliggende actief

Vervaldatum: december jaar T

EBA-instrumentvaluta: GBP

117. Short Futures NIKKEI 225 (Ticker: NKY).

Notional: equivalent van de indexwaarde maal 20 000 JPY.

Effectenbeurs: CME

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: JPY

118. Auto-callable eigenvermogensproduct

Longpositie

Boeking op “boekingsdatum”

Notioneel bedrag (“kapitaal”): 1 000 000 EUR

Onderliggende waarde: Index EURO STOXX 50 (Ticker: SX5E)

EBA-instrumentvaluta: EUR

Looptijd: 5 jaar

Jaarlijkse uitbetaling en jaarlijkse observatie (“boekingsdatum + 1 jaar”, “boekingsdatum + 2 jaar”, “boekingsdatum + 3 jaar”, “boekingsdatum + 4 jaar”, “boekingsdatum + 5 jaar”). Uitbetaling vindt plaats 10 dagen na de referentiedatum.

Coupon: 6 %

Autocall level (“Eerste waarde”): eind van de dag van de boekingsdatum + 1 maand

Beschermingsniveau couponbetaling 60 % van autocall level

Beschermingsniveau: 55 % van autocall level

— Kapitaal niet gegarandeerd indien de index onder het beschermingsniveau ligt (in jaar 5 terugbetaald kapitaal wordt geprorateerd indien het niveau onder het beschermingsniveau ligt: indien bijvoorbeeld SX5E = 40 % van het eerste niveau is, wordt 40 % van het kapitaal terugbetaald);

— Indien SX5E ≥ 60 % (beschermingsniveau coupon) van de eerste waarde aan het eind van enig jaar is, beloopt de uitgekeerde coupon 6 %;

— Indien SX5E ≥ 100 % van de eerste waarde aan het einde van enig jaar is, wordt het product "gecalled" en is de uitbetaling de coupon plus het kapitaal (100 %);

— Indien SX5E < 60 % (beschermingsniveau coupon) van de eerste waarde aan het eind van enig jaar is, wordt er geen coupon uitgekeerd;

— Indien SX5E < 55 % (beschermingsniveau) van de eerste waarde aan het einde van jaar 5 is, wordt het kapitaal alleen pro rata uitbetaald. Anders, indien SX5E ≥ 55 % (beschermingsniveau) van de eerste waarde aan het einde van jaar 5 is, wordt het kapitaal volledig betaald.

119. Long callopties. Onderliggende waarde EURO STOXX 50 index (Ticker: SX5E), ATM.

Notional: equivalent van de indexwaarde maal 1 000 EUR

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

120. Long callopties. Onderliggende waarde EURO STOXX 600 index (Ticker: SXXP), ATM.

Notional: equivalent van de indexwaarde maal 10 000 EUR

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: EUR

121. Long callopties. Onderliggende waarde VIX (CBOE), ATM.

Notional: equivalent van de indexwaarde maal 100 000 USD.

Vervaldatum: juni jaar T

EBA-instrumentvaluta: USD

IR

201. 5-jaars IRS EUR – Vaste rente ontvangen en variabele rente betalen.

Vastrentend deel: jaarlijks ontvangen

Variabele rente: 6-maands Euribor, halfjaarlijks betalen. Dagtelling: ACT/360

Notioneel: 10 000 000 EUR

Doorrolconventie en -kalender: standaard

Ingangsdatum op boekingsdatum (d.w.z. te hanteren rentetarieven zijn die bij sluiting van de markt op de boekingsdatum).

Vervaldag: september jaar T+4.

EBA-instrumentvaluta: EUR

202. 2-jaars EUR-swaption op 5-jaars IRS EUR – Vaste rente betalen en variabele rente ontvangen.

Notional: 10 000 000 EUR

De instelling is de verkoper van de optie op de swap. De tegenpartij van de instelling koopt het recht om een swap aan te gaan met de instelling; indien de tegenpartij haar recht uitoefent, ontvangt zij de vaste rente terwijl de instelling de variabele rente ontvangt.

Swaption met looptijd van twee jaar (boekingsdatum + 2 jaar) op renteswap (IRS) gedefinieerd als volgt: Fixed leg – jaarlijks betalen; Floating rate: 6-maands Euribor, halfjaarlijks ontvangen; Notional: 10 000 000 EUR; Doorrolconventie en -kalender: standaard; Effectieve datum onderliggende swap: boekingsdatum + 2 jaar.

Looptijd van de onderliggende swap: boekingsdatum + 7 jaar.

Premie betaald op de boekingsdatum (boekingsdatum). In contanten afgewikkeld.

De uitoefenprijs is gebaseerd op de ATM-rente van de in dit instrument vastgelegde forward starting swap

EBA-instrumentvaluta: EUR

203. 5-jaars IRS USD. Vaste rente ontvangen en variabele rente betalen.

Vaste rente: jaarlijks ontvangen

Variabele rente: 3-maands USD SOFR-tarief, elk kwartaal betalen

Notional: 1 000 000 USD

Doorrolconventie en -kalender: standaard

Ingangsdatum op boekingsdatum (d.w.z. te hanteren rentetarieven zijn die bij sluiting van de markt op de boekingsdatum).

Vervaldatum: september jaar T+4.

EBA-instrumentvaluta: USD

204. 2-jaars IRS USD. Vaste rente ontvangen en variabele rente betalen.

Vaste rente: jaarlijks ontvangen

Variabele rente: SONIA (overnight rate) opgerent en per kwartaal betaald. Dagtelling: ACT/365

Notioneel: 10 000 000 GBP

Doorrolconventie en -kalender: standaard

Ingangsdatum op boekingsdatum (d.w.z. te hanteren rentetarieven zijn die bij sluiting van de markt op de boekingsdatum).

Vervaldag: boekingsdatum + 2 jaar

EBA-instrumentvaluta: GBP

205. Door UBS verkochte collared 10y floating rate note.

Notioneel bedrag (hoofdsom): 1 000 000 USD.

Floating Rate Notes (“de Notes”) zijn senior ongedekte obligaties van UBS AG (“UBS”).

EBA-instrumentvaluta: USD

— De Notes dragen rente tegen een jaarlijks tarief gelijk aan USD 3-maands SOFR plus 1,5 % ’s jaars (“de variabele rente”), met een maximumtarief van 7,5 % ’s jaars (“het renteplafond”) en een minimumtarief van 2,5 % ’s jaars (“de bodemrente”).

— Betalingen op de Notes, met inbegrip van rente en hoofdsom op de vervaldag, zijn afhankelijk van de kredietwaardigheid van UBS AG. Instellingen wordt verzocht een passende disconteringscurve te gebruiken, die in de toelichting nader wordt onderbouwd.

— Inkomsten: over de Notes wordt per kwartaal een rente betaald die gelijk is aan de variabele rente, op voorwaarde dat indien op datums voor het vaststellen van de coupon i) de variabele rente lager is dan de bodemrente, het toepasselijke rentetarief voor de daarmee samenhangende renteperiode dan gelijk is aan de bodemrente, of ii) indien de variabele rente hoger is dan het renteplafond, het toepasselijke rentetarief voor de daarmee samenhangende renteperiode dan gelijk is aan het renteplafond.

Bedrag rentebetaling	Het over de Notes voor een renteperiode verschuldigde rentebedrag is gelijk aan het product van a) de hoofdsom van de Notes, b) het toepasselijke rentetarief voor die renteperiode, en c) een breuk, waarvan de teller het aantal dagen in de renteperiode is (berekend op basis van een jaar van 360 dagen met twaalf maanden van 30 dagen) en de noemer 360 is.
Datum van verhandeling en afwikkeling	"Boekingsdatum"
Datums rentebetaling	Per kwartaal, op de boekingsdatum + 3 maanden, boekingsdatum + 6 maanden, boekingsdatum + 9 maanden en boekingsdatum + 1 jaar, te beginnen bij boekingsdatum + 3 maanden, over de looptijd van de Notes (met aanpassingen, zoals daarin beschreven).
Vervaldatum	Boekingsdatum + 10 jaar
Valuta	USD
Dagtellingsconventie:	30/360
Conventie werkdagen	Following Unadjusted
Datum vaststelling coupon	Voor iedere renteperiode de tweede bankdag in Londen, onmiddellijk voorafgaand aan de betrokken rentedatum.
Datum	"Bankdag in Londen": een dag waarop commerciële banken open zijn voor het verrichten van bancaire diensten (met inbegrip van valutatransacties en deposito's in buitenlandse valuta) in Londen en waarop transacties in US-dollar op de Londense interbankenmarkt worden verricht.

206. Long GERMANY GOVT (Inflation) EUR 1 000 000 (ISIN DE0001030583).

Vervaldag: 15 april 2033

EBA-instrumentvaluta: EUR

207. Short GERMANY GOVT EUR 1 000 000 (ISIN DE0001030708).

Vervaldag: 15 augustus 2030

EBA-instrumentvaluta: EUR

208. Long ITALY GOVT (Inflation) EUR 1 000 000 (ISIN IT0005138828).

Vervaldag: 15 september 2032

EBA-instrumentvaluta: EUR

209. Long ITALY GOVT EUR 1 000 000 (ISIN IT0005340929).

Vervaldag: 1 december 2028

EBA-instrumentvaluta: EUR

210. Long SPAIN GOVT EUR 1 000 000 (ISIN ES00000127A2).

Vervaldag: 30 juli 2030

EBA-instrumentvaluta: EUR

211. Short FRANCE GOVT EUR 1 000 000 (ISIN FR0012993103).

Vervaldag: 25 mei 2031

EBA-instrumentvaluta: EUR

212. Short GERMANY GOVT EUR 1 000 000 (ISIN DE0001135176).

Vervaldag: 4 januari 2031

EBA-instrumentvaluta: EUR

213. Long UNITED KINGDOM GOVT GBP 1 000 000 (ISIN GB0004893086).

Vervaldag: 7 juni 2032

EBA-instrumentvaluta: GBP

214. Long PORTUGAL GOVT EUR 1 000 000 (ISIN PTOTEXOE0024).

Vervaldag: 15 juni 2029

EBA-instrumentvaluta: EUR

215. Short UNITED STATES GOVT USD 1 000 000 (ISIN US91282CAV37).

Vervaldag: 15 november 2030

EBA-instrumentvaluta: USD

216. Long BRAZIL GOVT (callable) 1 000 000 USD (ISIN US105756BZ27).

Vervaldag: 13 januari 2028

EBA-instrumentvaluta: USD

217. Long MEXICO GOVT (callable) 1 000 000 USD (ISIN US91087BAT70).

Vervaldag: 19 mei 2033

EBA-instrumentvaluta: USD

218. 10-jaars IRS EURO – Variabele rente ontvangen en vaste rente betalen.

Vastrentende deel: jaarlijks betalen.

Variabele rente: 3-maands Euribor, elk kwartaal ontvangen. Dagtelling: ACT/360

Notional: 10 000 000 EUR

Doorrolconventie en -kalender: standaard

Ingangsdatum op boekingsdatum (d.w.z. te gebruiken rentetarieven zijn die bij sluiting van de markt op boekingsdatum).

Vervaldag: Boekingsdatum + 10 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

219. 5-jaars IRS EURO – Variabele rente ontvangen en vaste rente betalen.

Vastrentende deel: jaarlijks betalen.

Variabele rente: 6-maands Euribor, elke 6 maanden ontvangen. Dagtelling: ACT/360

Notional: 10 000 000 EUR

Doorrolconventie en -kalender: standaard

Ingangsdatum op boekingsdatum (d.w.z. te gebruiken rentetarieven zijn die bij sluiting van de markt op boekingsdatum).

Vervaldag: boekingsdatum + 5 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

220. 5-year Mark-to-Market (MtM) Cross Currency EUR/USD SWAP. USD ontvangen en EUR betalen.

EUR: 3-maands ESTER, elk kwartaal betalen, opgerent met een betalingsvertraging van 2 dagen. Dagtelling: ACT/360

USD: 3-maands SOFR, elk kwartaal betalen, opgerent met een betalingsvertraging van 2 dagen. Dagtelling: ACT/360

Leg 1 – USD: Notional equivalent van 10 000 000 EUR, aangepast op kwartaalbasis

Leg 2 – USD: Notional 10 000 000 EUR

Doorrolconventie en -kalender: standaard

Ingangsdatum op boekingsdatum + zes maanden

Vervaldag: boekingsdatum + 5,5 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

Zie ook afdeling 6 van deze bijlage – Verdere specificaties voor instrumenten

221. 10-jaars IRS EURO – ESTER ontvangen en Euribor betalen.

ESTER leg: jaarlijks ontvangen. Dagtelling: ACT/360

EURIBOR leg: 3-maands Euribor + basis, elk kwartaal betalen. Dagtelling: ACT/360

Notional: 10 000 000 EUR

Doorrolconventie en -kalender: standaard

Ingangsdatum op boekingsdatum (d.w.z. te hanteren rentetarieven zijn die bij sluiting van de markt op de boekingsdatum).

Vervaldag: september jaar T + 9 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

222. Long ITALY GOVT (Inflation) EUR 1 000 000 (ISIN IT0005387052).

Vervaldag: 15 mei 2030

EBA-instrumentvaluta: EUR

223. 5-jaars Zero Coupon Inflation swap EUR – Inflatiegeïndexeerd rendement ontvangen en vaste rente betalen (r).

Inflatie-index: CPI (HICPxT)

Fixed leg (Betaal vast): $[(1 + r)^5 - 1]$

Ontvang inflatie-geïndexeerd rendement: $\left[\left(\frac{CPI \text{ op de einddatum (vervaldag)}}{CPI \text{ op de begindatum}}\right) - 1\right]$

Notional: 10 000 000 EUR

Basisfixingdatum: juni jaar T-1

Definitieve fixing: augustus jaar T+4

Looptijd: september jaar T+4.

EBA-instrumentvaluta: EUR

224. 2-jaars EUR-swaption op 5-jaars IRS EUR – vaste rente ontvangen en variabele rente betalen.

Notional: 10 000 000 EUR

De instelling is de verkoper van de optie op de swap. De tegenpartij van de instelling koopt het recht om een swap aan te gaan met de instelling; indien de tegenpartij haar recht uitoefent, ontvangt zij de variabele rente terwijl de instelling de vaste rente ontvangt.

Swaption met looptijd van twee jaar (boekingsdatum + 2 jaar) op renteswap (IRS) gedefinieerd als volgt: Fixed leg – jaarlijks ontvangen; Floating rate: 6-maands Euribor, elke 6 maanden betalen; Notional: 10 000 000 EUR; Doorrolconventie en -kalender: standaard; Effectieve datum onderliggende swap: boekingsdatum + 2 jaar.

Looptijd van de onderliggende swap: boekingsdatum + 7 jaar

Premie betaald op de boekingsdatum (boekingsdatum). In contanten afgewikkeld.

De uitoefenprijs is gebaseerd op de ATM-rente van de in dit instrument vastgelegde forward starting swap + 100 bp.

EBA-instrumentvaluta: EUR

FX

301. 6-maands USD/EUR forwardcontract. In contanten afgewikkeld. Long USD – Short EUR; Notional 10 000 000 USD; Forward Strike: gelijk aan 100 % van ECB-referentiespotrente EUR/USD aan het einde van de boekingsdatum.

EBA-instrumentvaluta: EUR

302. 6-maands EUR/GBP forwardcontract. In contanten afgewikkeld. Long EUR – Short GBP; Notional 10 000 000 GBP; Forward Strike: gelijk aan 100 % van ECB-referentiespotrente EUR/USD aan het einde van de boekingsdatum.

EBA-instrumentvaluta: EUR

303. Long 10 000 000 USD contanten.

Cashpositie. Te beschouwen als hebbende intrinsiek valutarisico zoals beschreven in punt kk).

EBA-instrumentvaluta: EUR

304. Long EUR/USD calloptie(long EUR, short USD). In contanten afgewikkeld. Notional: 10 000 000 EUR Equivalent bedrag op basis van ECB-referentiespotkoers EUR/USD aan het einde van de boekingsdatum.

Uitoefenprijs: 110 % van ECB-referentiekoers EUR/USD aan het einde van de boekingsdatum.

Vervaldatum: boekingsdatum + 1 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

305. Long EUR/USD calloptie (long EUR, short USD). In contanten afgewikkeld. Notional: 10 000 000 EUR Equivalent bedrag op basis van ECB-referentiespotkoers EUR/USD aan het einde van de boekingsdatum.

Uitoefenprijs: 90 % van ECB-referentiekoers EUR/USD aan het einde van de boekingsdatum.

Vervaldatum: boekingsdatum + 1 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

306. Short EUR/USD calloptie (short EUR, long USD). In contanten afgewikkeld. Notional: 10 000 000 EUR Equivalent bedrag op basis van ECB-referentiespotkoers EUR/USD aan het einde van de boekingsdatum.

Uitoefenprijs: 100 % van ECB-referentiekoers EUR/USD aan het einde van de boekingsdatum.

Vervaldatum: boekingsdatum + 1 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

307. Short EUR/USD calloptie (short EUR, long USD). In contanten afgewikkeld. Notional: 10 000 000 EUR Equivalent bedrag op basis van ECB-referentiespotkoers EUR/GBP aan het einde van de boekingsdatum.

Uitoefenprijs: 110 % van ECB-referentiekoers EUR/GBP aan het einde van de boekingsdatum.

Vervaldatum: boekingsdatum + 1 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

308. Long EUR/JPY putoptie (short EUR, long JPY). In contanten afgewikkeld. Notional: 10 000 000 EUR Equivalent bedrag op basis van ECB-referentiespotkoers EUR/JPY aan het einde van de boekingsdatum.

Uitoefenprijs: 110 % van ECB-referentiekoers EUR/JPY aan het einde van de boekingsdatum.

Vervaldatum: boekingsdatum + 1 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

309. Short EUR/AUD putoptie (long EUR, short AUD). In contanten afgewikkeld. Notional: 10 000 000 EUR Equivalent bedrag op basis van ECB-referentiespotkoers EUR/AUD aan het einde van de boekingsdatum.

Uitoefenprijs: 110 % van ECB-referentiekoers EUR/AUD aan het einde van de boekingsdatum.

Vervaldatum: boekingsdatum + 1 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

310. 6-maands EUR/DKK forwardcontract (long EUR, short DKK). In contanten afgewikkeld; Notional 10 000 000 EUR; ECB-referentiespotkoers EUR/DKK aan het einde van de boekingsdatum om de termijnkoers te bepalen.

EBA-instrumentvaluta: EUR

311. 6-maands EUR/BRL non deliverable forward contract (long EUR, short BRL); Notional 10 000 000 EUR; ECB-referentiespotkoers EUR/BRL aan het einde van de boekingsdatum om de termijnkoers te bepalen.

EBA-instrumentvaluta: EUR

GRONDSTOFFEN

401. Long 6-maands
3 500 troy ounces London Gold Forward (long Gold, short USD). In contanten afgewikkeld. Uitoefenprijs: 6-maands einde dag forwardkoers boekingsdatum

EBA-instrumentvaluta: USD

402. Short 12-maands 3 500 troy ounces London Gold Forward (short Gold, long USD). In contanten afgewikkeld. Uitoefenprijs: 12-maands einde dag forwardkoers boekingsdatum

EBA-instrumentvaluta: USD

403. Long calloptie 30 000 barrels Brent Crude Oil (long WTI, short USD). In contanten afgewikkeld. Uitoefenprijs: 12-maands einde dag forwardkoers boekingsdatum. Vervaldatum: boekingsdatum + 6 maanden

EBA-instrumentvaluta: USD

404. Short putoptie 30 000 barrels Brent Crude Oil (long WTI, short USD). In contanten afgewikkeld. Uitoefenprijs: 12-maands einde dag forwardkoers boekingsdatum. Vervaldatum: boekingsdatum + 6 maanden

EBA-instrumentvaluta: USD

405. Long calloptie 5 000 troy ounces London Gold Forward (long Gold, short USD). In contanten afgewikkeld. Uitoefenprijs: 18-maands einde dag forwardkoers boekingsdatum. Vervaldatum: boekingsdatum + 18 maanden

EBA-instrumentvaluta: USD

CREDITSPREAD

501. Long (d.w.z. protectie kopen) USD 1 000 000 CDS on PORTUGAL

Herstructureringsclausule: FULL

EBA-instrumentvaluta: USD

502. Long (d.w.z. protectie kopen) USD 1 000 000 CDS on ITALY.

Herstructureringsclausule: FULL
EBA-instrumentvaluta: USD

503. Short (d.w.z. protectie verkopen) USD 1 000 000 CDS on SPAIN

Herstructureringsclausule: FULL
EBA-instrumentvaluta: USD

504. Long (d.w.z. protectie kopen) USD 1 000 000 CDS on MEXICO

Herstructureringsclausule: FULL
EBA-instrumentvaluta: USD

505. Long (d.w.z. protectie kopen) USD 1 000 000 CDS on BRAZIL.

Herstructureringsclausule: FULL
EBA-instrumentvaluta: USD

506. Long (d.w.z. protectie kopen) USD 1 000 000 CDS on UK.

Herstructureringsclausule: FULL
EBA-instrumentvaluta: USD

507. Short (d.w.z. protectie verkopen) EUR 1 000 000 CDS on Telefónica (Ticker: TEF SM).

EBA-instrumentvaluta: EUR

508. Long (d.w.z. protectie kopen) EUR 1 000 000 CDS op Telefónica (Ticker: TEF SM).

Vervaldag: december jaar T+2
EBA-instrumentvaluta: EUR

509. Short (d.w.z. protectie verkopen) EUR 1 000 000 CDS on Aviva (Ticker: AV LN).

ISDA-definities jaar 2003
EBA-instrumentvaluta: EUR

510. Long (d.w.z. protectie kopen) EUR 1 000 000 CDS on Aviva (Ticker: AV LN).

ISDA-definities jaar 2003
Vervaldag: december jaar T+2
EBA-instrumentvaluta: EUR

511. Short (d.w.z. protectie verkopen) EUR 1 000 000 CDS on Vodafone (Ticker: VOD LN).

EBA-instrumentvaluta: EUR

512. Short (d.w.z. protectie verkopen) EUR 1 000 000 CDS on ENI SpA (Ticker: ENI IM).

EBA-instrumentvaluta: EUR

513. Short (d.w.z. protectie verkopen) USD 1 000 000 CDS on Eli Lilly (Ticker: LLY US).

Herstructureringsclausule: geen herstructurering (XR14)
EBA-instrumentvaluta: USD

514. Short (d.w.z. protectie verkopen) EUR 1 000 000 CDS on Unilever (Ticker: UNA NA).

EBA-instrumentvaluta: EUR

515. Long (d.w.z. protectie kopen) EUR 1 000 000 CDS on Total SA (Ticker: FP FP).

EBA-instrumentvaluta: EUR

516. Long (d.w.z. protectie kopen) EUR 1 000 000 CDS on Volkswagen Group (Ticker: VOW GR).

EBA-instrumentvaluta: EUR

517. Longpositie op TURKEY Govt. notes USD 1 000 000 (ISIN US900123CT57).

Vervaldag: 26 april 2029
EBA-instrumentvaluta: USD

518. Long (d.w.z. protectie kopen) USD 1 000 000 CDS on TURKEY. Ingangsdatum op boekingsdatum.

Herstructureringsclausule: FULL
EBA-instrumentvaluta: USD

519. Longpositie op Telefónica notes EUR 1 000 000 (ISIN XS1681521081).

Vervaldag: 12 januari 2028
EBA-instrumentvaluta: EUR

520. Longpositie op Volkswagen Group notes EUR 1 000 000 (ISIN XS2234567233).

Vervaldag: 22 september 2028
EBA-instrumentvaluta: EUR

521. Shortpositie op Volkswagen Group notes EUR 1 000 000 (ISIN XS1167667283).

Vervaldag: 16 januari 2030
EBA-instrumentvaluta: EUR

522. Longpositie op Total SA notes EUR 1 000 000 (ISIN XS1856281834).

Vervaldag: 11 juli 2033
EBA-instrumentvaluta: EUR

523. Long AUSTRIA GOVT EUR 1 000 000 (ISIN AT0000A04967).

Vervaldag: 15 maart 2037
EBA-instrumentvaluta: EUR

524. Long (d.w.z. protectie kopen) USD 1 000 000 CDS on AUSTRIA.

Vervaldag: juni jaar T+15
EBA-instrumentvaluta: USD

525. Long NETHERLANDS GOVT EUR 1 000 000 (ISIN NL0013552060).

Vervaldag: 15 januari 2040
EBA-instrumentvaluta: EUR

526. Long (i.e. protectie kopen) USD 1 000 000 CDS on NETHERLANDS.

Vervaldag: juni jaar T+20
EBA-instrumentvaluta: USD

527. Long BELGIUM GOVT EUR 1 000 000 (ISIN BE0000348574).

Vervaldag: 22 juni 2050
EBA-instrumentvaluta: EUR

528. Long (i.e. protectie kopen) USD 1 000 000 CDS on BELGIUM.

Vervaldag: juni jaar T+30

EBA-instrumentvaluta: USD

529. Long (protectie kopen) EUR 10 000 000 CDS op iTraxx Europe index on-the-run-reeks.

Vervaldag: juni jaar T+4

EBA-instrumentvaluta: EUR

530. Short putoptie. 10 000 000 EUR. Onderliggende waarde iTraxx Europe index on-the-run-reeks (zelfde instrument als 529).

Uitoefenprijs: ATM

Vervaldatum: boekingsdatum + 6 maanden

EBA-instrumentvaluta: EUR

531. Long AXA SA (callable) EUR 1 000 000 (ISIN XS1799611642).

Vervaldag: 28 mei 2049

EBA-instrumentvaluta: EUR

532. Long AT&T Bond (callable) USD 1 000 000 (ISIN US00206RFW79).

Vervaldag: 15 augustus 2037

EBA-instrumentvaluta: USD

533. Long BAYER AG (callable) EUR 1 000 000 (ISIN XS2199266268).

Vervaldag: 6 januari 2030

EBA-instrumentvaluta: EUR

534. Long ORANGE SA Bond (callable) EUR 1 000 000 (ISIN FR0013323870).

Vervaldag: 20 maart 2028

EBA-instrumentvaluta: EUR

CTP

601. Shortpositie (d.w.z. protectie verkopen) in iTraxx Europe index on-the-run-reeks.

Attachment point: 3 %

Detachment point: 6 %

Notional: 5 000 000 EUR

Looptijd: 5 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

602. Long (d.w.z. protectie kopen) EUR 5 000 000 CDS op iTraxx Europe index meest recente on-the-run-reeks.

Vervaldag: juni jaar T+4

EBA-instrumentvaluta: EUR

Notional aangepast voor volledige hedging CS01 van 601, geen re-hedging vereist

603. Longpositie (d.w.z. protectie kopen) in iTraxx Europe index on-the-run-reeks.

Attachment point: 3 %

Detachment point: 6 %

Notional: 5 000 000 EUR

Looptijd: 5 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

604. Short (d.w.z. protectie verkopen) EUR 5 000 000 CDS op iTraxx Europe index meest recente on-the-run-reeks.

Vervaldag: juni jaar T+4

EBA-instrumentvaluta: EUR

Notional aangepast voor volledige hedging CS01 van 603, geen re-hedging vereist

605. Shortpositie (d.w.z. protectie verkopen) in iTraxx Europe index on-the-run-reeks.

Attachment point: 12 %

Detachment point: 100 %

Notional: 5 000 000 EUR

Looptijd: 5 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

606. Long (d.w.z. protectie kopen) EUR 5 000 000 CDS op iTraxx Europe index meest recente on-the-run-reeks.

Vervaldag: juni jaar T+4

EBA-instrumentvaluta: EUR

Notional aangepast voor volledige hedging CS01 van 605, geen re-hedging vereist

607. Longpositie (d.w.z. protectie kopen) in iTraxx Europe index on-the-run-reeks.

Attachment point: 12 %

Detachment point: 100 %

Notional: 5 000 000 EUR

Looptijd: 5 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

608. Short (d.w.z. protectie verkopen) EUR 5 000 000 CDS op iTraxx Europe index meest recente on-the-run-reeks.

Vervaldag: juni jaar T+4

EBA-instrumentvaluta: EUR

Notional aangepast voor volledige hedging CS01 van 607, geen re-hedging vereist

609. Shortpositie (d.w.z. protectie verkopen) in iTraxx Europe index on-the-run-reeks.

Attachment point: 3 %

Detachment point: 6 %

Notional: 5 000 000 EUR

Looptijd: 5 jaar

EBA-instrumentvaluta: EUR

Inningspercentage: 40 % fixed.

610. Long (d.w.z. protectie kopen) EUR 5 000 000 CDS op iTraxx Europe index meest recente on-the-run-reeks.

Vervaldag: juni jaar T+4

EBA-instrumentvaluta: EUR

Notional aangepast voor volledige hedging CS01 van 609, geen re-hedging vereist

Afdeling 3: Individuele portefeuilles – Eén instrument

Instellingen verschaffen de gevraagde risicomaatstaven, samen met de contante waarde, van de volgende individuele portefeuilles:

Portefeuille	*Combinatie van instrumenten:* Het eerste cijfer staat voor het instrument (zoals vermeld in afdeling 2 van deze bijlage). Het tweede cijfer staat voor de hoeveelheid van elk instrument of het aantal contracten, al naargelang.	EBA-portefeuille valuta	Gevraagde risicomaatstaven
1001	101 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1002	102 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1003	103 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1004	104 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1005	105 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1006	106 – 1 instrument	GBP	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1007	107 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1008	108 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1009	109 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1010	110 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1011	111 – 1 instrument	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1012	112 – 1 instrument	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1013	113 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1014	114 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1015	115 – 1 instrument	GBP	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1016	116 – 1 instrument	GBP	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1017	117 – 1 instrument	JPY	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1018	118 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO

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

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

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

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

Afdeling 4: Individuele portefeuilles – Multi-instrumenten

Instellingen verschaffen de gevraagde risicomaatstaven, samen met de contante waarde, van de volgende individuele portefeuilles:

Portefeuille	*Combinatie van instrumenten:* Het eerste cijfer staat voor het instrument (zoals vermeld in afdeling 2 van deze bijlage). Het tweede cijfer staat voor de hoeveelheid van elk instrument of het aantal contracten, al naargelang.	EBA-portefeuillevaluta	Gevraagde risicomaatstaven
1101	103 – 1 instrument 104 – 1 instrument 105 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1102	113 – 1 instrument 110 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1103	115 – 1 instrument 116 – 1 instrument	GBP	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
1104	109 – 1 instrument 110 – 1 instrument	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO

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

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

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

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

Afdeling 5: Geaggregeerde portefeuilles

Instellingen verschaffen de gevraagde risicomaatstaven, samen met de contante waarde, van de volgende financiële geaggregeerde portefeuilles:

Geaggregeerde portefeuille	Beschrijving	*Combinatie van individuele portefeuilles* (individuele portefeuilles met hun nummers vermeld in de afdelingen 3 en 4 van deze bijlage)	EBA-portefeuillevaluta	Gevraagde risicomaatstaven
10000	ALL-IN no-CTP	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
11000	EQUITY gecumuleerd	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
12000	IR gecumuleerd	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
13000	Valuta gecumuleerd	3301, 3303, 3304	EUR	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
14000	Grondstoffen gecumuleerd	4401, 4402	USD	VaR; Stressed VaR; SBM; DRC; RRAO
15000	Creditspread gecumuleerd	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR; Stressed VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
16000	CTP gecumuleerd EUR	6601, 6602	EUR	VaR; Stressed VaR; APR; SBM; DRC; RRAO

Afdeling 6: Verdere specificaties voor instrumenten

Instellingen passen de volgende verdere specificaties toe voor de in afdeling 2 van deze bijlage beschreven financiële instrumenten:

Instrument:	220
Beschrijving:	5-jaars Mark-to-Market (MtM) Cross Currency EUR/USD SWAP USD ontvangen en EUR betalen Notional: 10 000 000 EUR, USD (10 000 000 EUR * FX USD/EUR)
Betalen:	Floating leg 2
Rec:	Floating leg 1
Notional Exchange en Reset:	Op ingangsdatum en vervaldatum. Voorts wordt op iedere couponbetalingsdatum een extra betaling gedaan die overeenstemt met de aanpassing van het notionele bedrag in US-dollar in floating leg 2. Het notionele bedrag in US-dollar wordt aangepast tot het equivalent van 10 000 000 EUR, tegen spotrate 2 werkdagen vóór elke betalingsdatum.
Kassaldo	Inbegrepen
Floating leg 1	
Notional:	10 000 000 EUR equivalent omgezet in US-dollar tegen spotrate op ingangsdatum, equivalent aangepast op kwartaalbasis
Ingangsdatum:	boekingsdatum + 6 maanden
Vervaldatum:	boekingsdatum + 5,5 jaar
Bepaling betalingsdatum:	Forward vanaf ingangsdatum:
Frequentie couponbetalingen:	Per kwartaal
Couponpercentage:	3-maands SOFR + 0 bp
Frequentie reset couponpercentage:	Per kwartaal
Conventie vaststelling couponpercentage:	Dagelijks opgerent over de periode van drie maanden
Frequentie compounding couponpercentage:	Enkelvoudige rente
Dagtelling:	ACT/360
Betaling werkdag:	LON, NYC, TARGET
Conventie betaling werkdag:	Modified Following
Werkdag Notional Reset:	LON, NYC, TARGET
Conventie werkdag Notional Reset:	Voorgaande
Werkdag reset couponpercentage:	LON, NYC, TARGET
Conventie werkdag reset couponpercentage:	Voorgaande

Floating leg 2	
Notional:	10 000 000 EUR
Ingangsdatum:	boekingsdatum + 6 maanden
Vervaldatum:	boekingsdatum + 5,5 jaar
Bepaling betalingsdatum:	Forward vanaf ingangsdatum:
Frequentie couponbetalingen:	Per kwartaal
Couponpercentage:	3-maands ESTER + 0 bp
Frequentie reset couponpercentage:	Per kwartaal
Conventie vaststelling couponpercentage:	Dagelijks opgerent over de periode van drie maanden
Frequentie compounding couponpercentage:	Enkelvoudige rente
Dagtelling:	ACT/360
Betaling werkdag:	LON, NYC, TARGET
Betaling werkdag:	Modified Following
Werkdag Notional Reset:	LON, NYC, TARGET
Conventie werkdag Notional Reset:	Voorgaande
Werkdag reset couponpercentage:	LON, NYC, TARGET
Conventie werkdag reset couponpercentage:	Voorgaande

Afdeling 7: SBM-validatieportefeuilles

(a) Instellingen verschaffen de SBM-risicomaatstaf van de in bijlage X gedefinieerde portefeuilles (SBM-validatieportefeuilles) als onderdeel van de IMV-indiening en dienen deze overeenkomstig de rapportagedatums van de IMV-indiening in.

(b) Het volgende geldt voor de indiening van de resultaten die beantwoorden aan de SBM-validatieportefeuilles:

i. Instellingen rapporteren alleen template C 120.02 en beperken de rapportage in deze template tot de resultaten in de rapportagevaluta (d.w.z. kolom 0060 van template C120.02 wordt niet ingevuld en de templates C 106.00 en C 106.01 worden niet gerapporteerd voor de SBM-validatieportefeuilles).

ii. Instellingen hanteren de aanname dat de risicogevoeligheden en de curvatuurrisicoposities die door de in bijlage X gespecificeerde instrumenten worden gedefinieerd, zijn uitgedrukt in de rapportagevaluta van de instelling en dat de informatie wordt verstrekt in het formaat gespecificeerd in de rapportage-instructies voor templates C 106.01 / C 120.01 en de overeenkomstige tabel met instructies voor het rapporteren van deze templates in bijlage VI (Instructies met betrekking tot de templates)."

BIJLAGE III

"BIJLAGE VI

RESULTATEN BENCHMARKINGPORTEFEUILLES TEN BEHOEVE VAN TOEZICHT

INSTRUCTIES MET BETREKKING TOT DE TEMPLATES

C 106.00 – Eerste marktwaardering en rechtvaardiging uitsluiting 57
C 106.01 – SBM. Risicogevoeligheden per instrument 57
C 107.01 – VaR en sVaR – Non-CTP. Nadere bijzonderheden. 61
C 107.02 – VaR, sVaR en PV - Non-CHP. Resultaten EBA-portefeuillevaluta 63
C 108.00 – Winst & verlies (P&L)-tijdreeksen 64
C 109.01 – IRC. Bijzonderheden van het model 65
C 109.02 – IRC. Nadere bijzonderheden per portefeuille 65
C 109.03 – IRC. Bedrag per portefeuille/datum 66
C 110.01 – CT. Nadere bijzonderheden van het model 67
C 110.02 – CT. Nadere bijzonderheden per portefeuille 68
C 110.03 – CT. APR per portefeuille/datum 69
C 120.01 – SBM. RISICOGEVOELIGHEDEN PER INSTRUMENT/PORTEFEUILLE 69
C 120.02 – SBM. OFR SAMENSTELLING PER PORTEFEUILLE 72
C 120.04 – DRC. MARKTWAARDEN EN BRUTO JTD-BEDRAGEN PER INSTRUMENT/PORTEFEUILLE 74
C 120.05 – DRC. OFR SAMENSTELLING PER PORTEFEUILLE 80
C 120.06 – ASA. OFR 82

INSTRUCTIES MET BETREKKING TOT DE TEMPLATES

C 106.00 – Eerste marktwaardering en rechtvaardiging uitsluiting

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Nummer instrument	Bijlage V, afdeling 2	Het instrumentnummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.
0020	Instrument gemodelleerd voor VaR en sVaR (WAAR/ONWAAR)		WAAR of ONWAAR rapporteren.
0030	Instrument gemodelleerd voor IRC (WAAR/ONWAAR)		WAAR of ONWAAR rapporteren.
0040	Instrument gemodelleerd voor correlatiehandel (WAAR/ONWAAR)		WAAR of ONWAAR rapporteren.
0050	Reden voor uitsluiting	Artikel 3, lid 2	Een van de volgende elementen wordt gerapporteerd: (a) Model niet toegestaan door de toezichthouder; (b) Instrument of onderliggende waarde intern niet toegestaan; (c) Onderliggende waarde of modelleringskenmerken intern niet in aanmerking genomen; (d) Andere redenen voor uitsluiting. Licht die redenen dan toe in kolom 0060.
0060	Ruimte voor vrije tekst		Een instelling kan in deze kolom aanvullende informatie geven.
0070	Eerste marktwaardering ("IMV")		De marktwaarde (mark-to-market) van elk instrument op de referentiedatum om 17.30 u CET (zoals vermeld in bijlage V, afdeling 1, punt b)). De cel wordt blanco gelaten indien de instelling geen IMV voor een bepaalde portefeuille wil verstrekken (d.w.z. nulwaarden worden alleen gerapporteerd als het resultaat van de berekening nul is).

C 106.01 — SBM. Risicogevoeligheden per instrument

Instellingen rapporteren de gevoeligheden voor de risicofactoren waaraan het instrument is blootgesteld. Per risicofactor/gevoeligheid wordt één rij gerapporteerd. De opwaartse nettocurvatuurrisicopositie van die risicofactor (CVRk+) of de neerwaartse nettocurvatuurrisicopositie van die risicofactor (CVRk-) zoals gespecificeerd in artikel 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013 worden in afzonderlijke rijen gerapporteerd. Alle waarden verwijzen naar de "IMV (en begin-SBM) referentiedatum" zoals gespecificeerd in afdeling 1, punt b), ii), van bijlage V bij deze verordening. Instellingen rapporteren elke combinatie van instrumentnummer, risico-identificatiecode (kolom 0010), subklasse (kolom 0020) en aanvullende identificatiecode (kolom 0030) slechts eenmaal.

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Instrumentnummer	Bijlage V, afdeling 2	Het instrumentnummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Identificatiecode risicofactor	Artikelen 325 terdecies, 325 quaterdecies, 325 quindecies, 325 sexdecies, 325 septdecies en 325 octodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013	De identificatiecode van de risicofactor zoals gespecificeerd in de tabel aan het einde van deze bijlage wordt gerapporteerd.
0020	Subklasse	Artikel 325 quinquies, lid 3, van Verordening (EU) nr. 575/2013	De subklasse wordt als volgt gerapporteerd. Wanneer de in kolom 0010 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met de risicoklasse: — “algemeen renterisico”, is het antwoord de naam van de valuta van de desbetreffende risicofactor “risicovrije rente”, “inflatierisco” of “cross-currencybasisrisico” (valuta-aanduiding volgens ISO 4217, bv. “EUR”); — “creditspreadrisico voor niet-securitisatie”, is het antwoord het nummer van de subklasse in artikel 325 quintricies, lid 1, tabel 4, van Verordening (EU) nr. 575/2013; — “creditspreadrisico voor securitisatie niet opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (non-ACHP CSR)”, is het antwoord het nummer van de subklasse in artikel 325 quadragies, lid 1, tabel 7, van die verordening; — “creditspreadrisico voor securitisatie opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (ACHP CSR)”, is het antwoord het nummer van de subklasse in artikel 325 octotricies, tabel 6, van die verordening; — “aandelenrisico”, is het antwoord het nummer van de subklasse in artikel 325 terquadragies, lid 1, tabel 8, van die verordening; — “grondstoffenrisico”, is het antwoord het nummer van de subklasse in artikel 325 sexquadragies, tabel 9, van die verordening; — “valutarisico en de delta- of curvatuurcomponenten”, is het antwoord de naam van de valuta (bv. “USD”; de valutacodes worden gerapporteerd volgens ISO 4217 valuta-aanduiding); — “valutarisico en de vega-component”, is het antwoord de naam van het valutapaar (bv. “EUR_USD”; de valutacodes worden gerapporteerd volgens de ISO 4217 valuta-aanduiding).
0030	Aanvullende identificator 1	Artikelen 325 terdecies t/m 325 octodecies en artikel 325 sextricies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Om de risicofactor binnen de subklassen te onderscheiden, wordt de volgende informatie gerapporteerd. Wanneer de in kolom 0010 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met de risicoklasse: — “algemeen renterisico en de deltacomponent”, is het antwoord de naam van de risicovrije curve of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode; — “creditspreadrisico voor niet-securitisatie of de risicoklasse creditspreadrisico voor securitisatie opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (ACHP CSR)”, is het antwoord de naam van de emittent of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode en is deze identiek voor alle twee gerapporteerde gevoeligheden voor twee

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			risicofactoren die een correlatieparameter $\rho_{kl}^{(naam)}$ gelijk aan 1 krijgen overeenkomstig artikel 325 sextricies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013; — "creditspreadrisico voor securitisatie niet opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (non-ACHP CSR)", is het antwoord de naam van de tranche of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode; — "aandelenrisico", is het antwoord de naam van de emittent van de aandelen of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode; — "grondstoffenrisico", is het antwoord de naam van de grondstof of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode. Wanneer geen van deze gevallen van toepassing is, rapporteren instellingen een expliciete waarde (NULL) als niet van toepassing.
0050	Risicogevoeligheid (resultaten rapportagevaluta)	Artikel 325 quinquies, lid 2, en de artikelen 325 octies, 325 novodecies, 325 vicies, 325 unvicies en325unquinquagies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Risicogevoeligheden (delta-/vegagevoeligheden en curvatuurrisicoposities) worden gerapporteerd op het niveau van elk instrument voor alle relevante risicofactoren zoals gespecificeerd in de kolommen 0010 tot en met 0030. De waarden worden gerapporteerd in de rapportagevaluta van de instelling. Wanneer de in kolom 0010 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met: — de deltarisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, wordt de nettogevoeligheid voor de risicofactor (S_k) zoals gespecificeerd in artikel 325 novodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013 gerapporteerd. Wanneer instellingen, overeenkomstig artikel 325 unvicies, lid 5, van die verordening, van hun bevoegde autoriteit toestemming hebben gekregen om alternatieve definities van deltarisicogevoeligheden te gebruiken, verwijzen zij voor de rapportage naar die alternatieve definities; — de vegarisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, wordt de vegarisicogevoeligheid van een optie voor een gegeven risicofactor (S_k) zoals gespecificeerd in artikel 325 vicies van Verordening (EU) nr. 575/2013 gerapporteerd. Wanneer instellingen, overeenkomstig artikel 325 unvicies, lid 6, van die verordening, van hun bevoegde autoriteit toestemming hebben gekregen om alternatieve berekeningen van vegarisicogevoeligheden te gebruiken, verwijzen zij voor de rapportage naar die alternatieve berekeningen. Ongeacht of de instelling gebruikmaakt van de definitie van artikel 325 vicies of van een alternatieve berekening overeenkomstig artikel 325 unvicies, lid 6, van die verordening, wordt de gevoeligheid gerapporteerd na weging voor de overeenkomstige geïmpliceerde volatiliteit; — de curvatuurrisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, wordt de opwaartse nettocurvatuurrisicopositie van die risicofactor (CVR_k^+) of de neerwaartse nettocurvatuurrisicopositie van die risicofactor (CVR_k^-) zoals gespecificeerd in artikel 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013 gerapporteerd. De gerapporteerde waarde wordt uitgedrukt als een getal met een nauwkeurigheid van minimaal twee cijfers na de komma. Nulwaarden mogen alleen worden gerapporteerd wanneer het resultaat van de berekening daadwerkelijk nul is.
0060	Rapportagevaluta		De naam van de rapportagevaluta van de instelling wordt gerapporteerd (de gerapporteerde waarde volgt de ISO 4217 valuta-aanduiding, bv. "EUR").

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0070	Risicogevoeligheid (resultaten valuta EBA-instrument)	Afdeling 2 van bijlage V bij deze verordening en Artikel 325 quinquies, lid 2, en de artikelen 325 octies, 325 novodecies, 325 vicies van Verordening (EU) nr. 575/2013	De waarden worden gerapporteerd volgens de instructies voor kolom 0050, maar omgerekend tegen de contante wisselkoers van de ECB voor de valuta van het instrument als omschreven in afdeling 2 van bijlage V bij deze verordening.
0080	Prijsmodel	Artikel 325 unvicies van Verordening (EU) nr. 575/2013	De instelling specificeert welk prijsmodel van toepassing is om de gevoeligheden af te leiden. Een van de volgende elementen wordt gerapporteerd: (a) "prijsmodellen van de instelling die als basis dienen om winsten en verliezen aan de directie te rapporteren" (zoals voor artikel 325 unvicies, lid 1, eerste alinea, van Verordening (EU) nr. 575/2013); (b) "internemodellenbenadering van de instelling" (zoals voor artikel 325 unvicies, lid 1, tweede alinea, van die verordening).
0090	Definitie gevoeligheden	Artikelen 325 novodecies, 325 vicies en 325 unvicies van Verordening (EU) nr. 575/2013	De instelling specificeert welke definitie van gevoeligheden bij de berekening van de eigenvermogensvereisten wordt toegepast. Een van de volgende elementen wordt gerapporteerd: (a) "gevoeligheden als gedefinieerd in de artikelen 325 novodecies en 325 vicies van Verordening (EU) nr. 575/2013"; (b) "gevoeligheden als gedefinieerd in artikel 325 unvicies, leden 5 en 6, van Verordening (EU) 575/2013". Wanneer de in kolom 0010 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met de curvatuurrisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, wordt de in punt b) vermelde waarde gerapporteerd indien een van de bij de berekening van de gerapporteerde curvatuurrisicopositie gebruikte gevoeligheden gebaseerd is op een gevoeligheidsdefinitie overeenkomstig artikel 325 unvicies, leden 5 en 6, van Verordening (EU) nr. 575/2013. Anders wordt de in punt a) vermelde waarde gerapporteerd.
0100	Ruimte voor vrije tekst		Een instelling kan in deze kolom aanvullende informatie verstrekken over het prijsmodel en de definitie van de gevoeligheden die zijn gehanteerd.
0110	Aanvullende identificator 2	Artikel 325 septdecies, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de in kolom 0010 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met de risicoklasse "grondstoffenrisico" en de deltarisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, is het antwoord de reeks wettelijke voorwaarden betreffende de leveringsplaats of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode. Wanneer geen van deze gevallen van toepassing is, rapporteren instellingen een expliciete waarde (NULL) als niet van toepassing.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0120	Kredietkwaliteits-categorie	Artikel 325 terdecies, lid 1, en artikel 325 quintricies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de in kolom 0010 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met de risicoklasse "creditspreadrisico voor niet-securitisaties" en de deltarisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, is het antwoord een van de volgende: (a) "CQS 1"; (b) "CQS 2"; (c) "CQS 3"; (d) "CQS 4"; (e) "CQS 5"; (f) "CQS 6"; (g) "Geen CQS toegekend (zonder rating)". Wanneer geen van deze gevallen van toepassing is, rapporteren instellingen een expliciete waarde (NULL) als niet van toepassing.

C 107.01 – VaR en sVaR – Non-CTP. Nadere bijzonderheden.

Rij	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010 - 0060	VaR		
0010	Methodologie		Een van de volgende elementen rapporteren in kolom 0010: (a) Historische simulatie; (b) Monte-Carlosimulatie; (c) Parametrische methode; (d) Combinatie / andere methode (specificeren s.v.p.). De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken. Wanneer in kolom 0010 voor optie d) is gekozen, verschaft de instelling nadere bijzonderheden in kolom 0020.
0020	Berekening 10-daagse horizon	Artikel 365, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Een van de volgende elementen wordt gerapporteerd in kolom 0010: (a) 1 dag herschaald tot 10 dagen; (b) 10 dagen met overlappende perioden; (c) 10 dagen andere methodologie. De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken.
0030	Lengte observatieperiode	Artikel 365, lid 1, punt d), van Verordening (EU) nr. 575/2013	Een van de volgende elementen wordt gerapporteerd in kolom 0010: (a) tot 1 jaar; (b) meer dan 1 jaar en tot 2 jaar; (c) meer dan 2 jaar en tot 3 jaar; (d) meer dan 3 jaar. De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken.

Rij	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0040	Data weging	Artikel 365, lid 1, punt d), van Verordening (EU) nr. 575/2013	Een van de volgende elementen wordt gerapporteerd in kolom 0010: (a) Ongewogen (weging VaR-data); (b) Gewogen (weging VaR-data); (c) Hoogste van gewogen en ongewogen (weging VaR-data) in de punten a) en b). De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken.
0050	Opslagfactor backtesting	Artikel 366, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Met "opslagfactor backtesting" wordt het optelgetal bedoeld met een waarde tussen 0 en 1 in overeenstemming met artikel 366, lid 2, tabel 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013. De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken.
0060	VaR-opslagfactor op grond van regelgeving	Artikel 366, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013 ("ten minste 3").	Onder "VaR-opslagfactor op grond van de regelgeving" wordt het extra vereiste verstaan dat door de bevoegde autoriteit in overeenstemming met artikel 366, lid 2, Verordening (EU) nr. 575/2013 wordt opgelegd met betrekking tot de vermenigvuldigingsfactor voor VaR (ten minste 3). De VaR-opslagfactor op grond van de regelgeving is de som van de opslagfactor voor backtesting en de kwalitatieve opslagfactor (in voorkomend geval) die hoger is dan 3. De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken.
0070 - 0100	sVaR (d.w.z. Stressed VaR)		
0070	Methodologie		Een van de volgende elementen wordt gerapporteerd in kolom 0010: (a) Historische simulatie; (b) Monte-Carlosimulatie; (c) Parametrische methode; (d) Combinatie / andere methode (specificeren s.v.p.). De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken. Wanneer in kolom 0010 voor optie d) is gekozen, verschaft de instelling nadere bijzonderheden in kolom 0020.
0080	Berekening 10-daagse horizon	Artikel 365, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Een van de volgende elementen wordt gerapporteerd in kolom 0010: (a) 1 dag herschaald tot 10 dagen; (b) 10 dagen met overlappende perioden; (c) 10 dagen andere methodologie. De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken.
0090	sVaR-opslagfactor op grond van regelgeving	Artikel 366, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Onder "opslagfactor op grond van de regelgeving" wordt het extra vereiste verstaan dat door de bevoegde autoriteit in overeenstemming met artikel 366, lid 2, Verordening (EU) nr. 575/2013 wordt opgelegd met betrekking tot de vermenigvuldigingsfactor voor sVaR (ten minste 3). De opslagfactor op grond van de regelgeving is de som van 3, de opslagfactor voor backtesting en de kwalitatieve opslagfactor (in voorkomend geval).

Rij	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken.
0100	sVaR-periode	Artikel 365, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Een van de volgende elementen wordt gerapporteerd in kolom 0010: (a) Dagelijkse berekening van de stressed VaR, gekalibreerd op één ononderbroken periode van 12 maanden vanaf de in kolom 0020 vermelde datum; (b) Wekelijkse berekening van de stressed VaR, gekalibreerd op één ononderbroken periode van 12 maanden vanaf de in kolom 0020 vermelde datum; (c) Dagelijkse berekening van de stressed VaR, gekalibreerd op verschillende ononderbroken periodes van 12 maanden tijdens de stressed VaR-rapportagedatums in kolom 0010 van C 107.02 vanaf de in kolom 0020 vermelde datums. (d) Wekelijkse berekening van de stressed VaR, gekalibreerd op verschillende ononderbroken periodes van 12 maanden tijdens de stressed VaR-rapportagedatums in kolom 0010 van C 107.02 vanaf de in kolom 0020 vermelde datums; (e) Maximum van de dagelijkse berekening van de stressed VaR, gekalibreerd op meer dan één periode van 12 maanden; (f) Maximum van de wekelijkse berekening van de stressed VaR, gekalibreerd op meer dan één periode van 12 maanden; (g) Andere keuzes voor de stressed VaR-kalibratie (specificeren s.v.p.). De instelling gebruikt kolom 0020 om de aanvangsdatum te geven in het formaat “dd/mm/jjjj” in het geval van de opties a) of b) in kolom 0010, en de aanvangsdatums in het formaat “dd/mm/jjjj” bij elke berekening van de stressed VaR in het geval van de opties c) of d) in kolom 0010. De instelling gebruikt kolom 0020 ook om meer duidelijkheid te verschaffen over de 12-maands periode die voor elke berekening van de stressed VaR bij de opties e), f) en g) in kolom 0010 wordt gebruikt.

C 107.02 – VaR, sVaR en PV - Non-CHP. Resultaten EBA-portefeuillevaluta

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Portefeuille	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Datum		Resultaten voor VaR, sVaR en contante waarde (PV) worden gerapporteerd voor alle 10 werkdagen tussen de “RM-beginreferentiedatum” en de “RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum”, zoals gespecificeerd in bijlage V, afdeling 1, punt b). Voor het rapporteren van de datums wordt de “dd/mm/jjjj”-conventie gebruikt.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0020	VaR	Artikel 365 van Verordening (EU) nr. 575/2013	Voor iedere portefeuille wordt de verkregen 10-daagse VaR op grond van de regelgeving gerapporteerd, zonder toepassing van de "ten minste 3"-vermenigvuldigingsfactor op grond van de regelgeving. Cijfers worden gerapporteerd voor elke datum in kolom 0010. De cel blanco laten indien de instelling geen sVar berekent op de datum in kolom 0010 (d.w.z. nulwaarden alleen rapporteren als het resultaat van de berekening daadwerkelijk nul is).
0030	sVaR	Artikel 365 van Verordening (EU) nr. 575/2013	Voor iedere portefeuille wordt de verkregen 10-daagse sVaR op grond van de regelgeving gerapporteerd, zonder toepassing van de "ten minste 3"-vermenigvuldigingsfactor op grond van de regelgeving. Cijfers worden gerapporteerd voor elke datum in kolom 0010. De cel blanco laten indien de instelling geen sVar berekent op de in kolom 0010 vermelde datum (d.w.z. nulwaarden alleen rapporteren als het resultaat van de berekening nul is).
0040	PV		Voor iedere portefeuille wordt de PV gerapporteerd. Cijfers worden gerapporteerd voor elke datum in kolom 0010. De cel blanco laten indien de instelling geen PV berekent op de in kolom 0010 vermelde datum (d.w.z. nulwaarden alleen rapporteren als het resultaat van de berekening daadwerkelijk nul is).

C 108.00 – Winst & verlies (P&L)-tijdreeksen

Template C 108.00 ("Winst & verlies (P&L)-tijdreeksen") wordt alleen ingevuld door instellingen die de VaR berekenen via historische simulatie.

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Portefeuille	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Datum	Artikel 365, lid 1, punt d), van Verordening (EU) nr. 575/2013	Op elke werkdag verstrekken instellingen, overeenkomstig de kalender in de jurisdictie van de instelling, de P&L-reeksen die worden gebruikt voor de berekening van de VaR in C 107.02, kolom 0010, met een minimum van 250 observaties, aflopend vanaf de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum", zoals gespecificeerd in afdeling 1, punt b), v), van bijlage V bij deze verordening.
0020	Dagelijkse P&L		Instellingen die de VaR via historische simulatie berekenen, vullen de door de instelling gebruikte volledige historische reeksen in, met minimaal 1-jaars datareeksen, met de verandering van de waardering van de portefeuille (d.w.z. dagelijkse P&L) verkregen door gebruik te maken van historisch gesimuleerde dagelijkse wijzigingen van de risicofactoren (d.w.z. de dagelijkse P&L-reeks gebruikt om de voorgeschreven 1-dags VaR af te leiden).

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			Ingeval een dag een wettelijke feestdag is in de desbetreffende jurisdictie, wordt deze cel blanco gelaten (d.w.z. een P&L van nul wordt alleen gerapporteerd indien er op een bepaalde werkdag geen verandering in de hypothetische waarde van de portefeuille plaatsvond).

C 109.01 - IRC. Bijzonderheden van het model

Rij	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Aantal modellerende factoren		EBA/GL/2012/3 Het aantal modellerende factoren op het niveau van het algemene IRC-model wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) 1 modellerende factor; (b) 2 modellerende factoren; (c) meer dan 2 modellerende factoren. De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken.
0020	Bron LGD's		EBA/GL/2012/3 De bron van LGD's op het niveau van het algemene IRC-model wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) Marktconventie; (b) LGD gebruikt in IRB; (c) Andere bron van LGD (specificeren s.v.p.). De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken. Wanneer in kolom 0010 voor optie c) is gekozen, verschaft de instelling in deze kolom nadere bijzonderheden.

C 109.02 - IRC. Nadere bijzonderheden per portefeuille

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Portefeuille	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt alleen gerapporteerd voor de portefeuilles waarvoor IRC wordt gevraagd.

Rij	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Liquiditeitshorizon	Artikel 374, lid 5, van Verordening (EU) nr. 575/2013	EBA/GL/2012/3 De op portefeuilleniveau toegepaste liquiditeitshorizon wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) tot 3 maanden (b) meer dan 3 maanden en tot 6 maanden; (c) meer dan 6 maanden en tot 9 maanden; (d) meer dan 9 maanden en tot 12 maanden.
0020	Bron PD's		EBA/GL/2012/3 De op portefeuilleniveau toegepaste bron van PD's wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) Ratingbureaus; (b) IRB; (c) Door de markt geïmpliceerde PD's; (d) Andere bron van PD's (specificeren s.v.p.). De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken. Wanneer in kolom 0010 voor optie d) is gekozen, verschaft de instelling nadere bijzonderheden in deze kolom 0020.
0030	Bron overgangsmatrices		EBA/GL/2012/3 De op portefeuilleniveau toegepaste bron van overgangsmatrices wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) Ratingbureaus; (b) IRB; (c) Door de markt geïmpliceerde overgangsmatrices; (d) Andere bronnen van overgangsmatrices (specificeren s.v.p.). De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken. Wanneer in kolom 0010 voor optie d) is gekozen, verschaft de instelling nadere bijzonderheden in deze kolom 0020.

C 109.03 - IRC. Bedrag per portefeuille/datum

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Portefeuille	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt alleen gerapporteerd voor de portefeuilles waarvoor IRC wordt gevraagd.

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

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Datum		IRC wordt gerapporteerd voor alle 10 werkdagen tussen de "RM-beginreferentiedatum" en de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum", zoals gespecificeerd in bijlage V, afdeling 1, punt b). Voor het rapporteren van de datums wordt de "dd/mm/jjjj"-conventie gebruikt.
0020	IRC	Artikelen 372 t/m 376 van Verordening (EU) nr. 575/2013	EBA/GL/2012/3 De voor iedere portefeuille verkregen IRC op grond van de regelgeving wordt gerapporteerd. Cijfers worden gerapporteerd voor elke datum in kolom 0010. De cel blanco laten indien de instelling geen IRC berekent op de in kolom 0010 gerapporteerde datum (d.w.z. nulwaarden alleen rapporteren als het resultaat van de berekening nul is).

C 110.01 – CT. Nadere bijzonderheden van het model

Rij	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Aantal modellerende factoren	Artikel 377 van Verordening (EU) nr. 575/2013	Het aantal modellerende factoren op het niveau van het algemene correlatiehandelsmodel wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) 1 modellerende factor; (b) 2 modellerende factoren; (c) meer dan 2 modellerende factoren. De instelling gebruikt kolom 0020 indien zij het antwoord in kolom 0010 wil verduidelijken.
0020	Bron LGD's	Artikel 377 van Verordening (EU) nr. 575/2013	De bron van LGD's op het niveau van het algemene correlatiehandelsmodel wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) Marktconventie; (b) LGD gebruikt in IRB; (c) Andere bron van LGD (specificeren s.v.p.). De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken. Wanneer in kolom 0010 voor optie c) is gekozen, verschaft de instelling in deze kolom nadere bijzonderheden.

C 110.02 – CT. Nadere bijzonderheden per portefeuille

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Portefeuille	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt alleen gerapporteerd voor de portefeuilles waarvoor APR wordt gevraagd.

Rij	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Liquiditeitshorizon	Artikel 377, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	De op portefeuilleniveau toegepaste liquiditeitshorizon wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) tot 3 maanden (b) meer dan 3 maanden en tot 6 maanden; (c) meer dan 6 maanden en tot 9 maanden; (d) meer dan 9 maanden en tot 12 maanden.
0020	Bron PD's	Artikel 377 van Verordening (EU) nr. 575/2013	De op portefeuilleniveau toegepaste bron van PD's wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) Ratingbureaus; (b) IRB; (c) Door de markt geïmpliceerde PD's; (d) Andere bron van PD's (specificeren s.v.p.). De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken. Wanneer in kolom 0010 voor optie d) is gekozen, verschaft de instelling nadere bijzonderheden in kolom 0020.
0030	Bron overgangsmatrices	Artikel 377 van Verordening (EU) nr. 575/2013	De op portefeuilleniveau toegepaste bron van overgangsmatrices wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) Ratingbureaus; (b) IRB; (c) Door de markt geïmpliceerde overgangsmatrices; (d) Andere bronnen van overgangsmatrices (specificeren s.v.p.). De instelling gebruikt kolom 0020 om het antwoord in kolom 0010 te verduidelijken. Wanneer in kolom 0010 voor optie d) is gekozen, verschaft de instelling nadere bijzonderheden in kolom 0020.

C 110.03 – CT. APR per portefeuille/datum

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Portefeuille	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt alleen gerapporteerd voor de portefeuilles waarvoor APR wordt gevraagd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Datum	Artikel 377 van Verordening (EU) nr. 575/2013	All Price risk ("APR") wordt gerapporteerd voor alle 10 werkdagen tussen de "RM-beginreferentiedatum" en de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (als bedoeld in afdeling 1, punt b), van bijlage V). Voor het rapporteren van de datums wordt de "dd/mm/jjjj"-conventie gebruikt.
0060	APR	Artikel 377 van Verordening (EU) nr. 575/2013	Gerapporteerd worden de resultaten die zijn verkregen door op iedere portefeuille het correlatiehandelsmodel op grond van de regelgeving toe te passen. Cijfers worden gerapporteerd voor elke datum in kolom 0010. De cel blanco laten indien de instelling geen correlatiehandelsmodel gebruikt op de in kolom 0010 vermelde datum (d.w.z. nulwaarden alleen rapporteren als het resultaat van de berekening nul is).

C 120.01 — SBM. RISICOGEVOELIGHEDEN PER INSTRUMENT/PORTEFEUILLE

Instellingen rapporteren per instrument de gevoeligheden voor de risicofactoren waaraan het instrument is blootgesteld. Per risicofactor/gevoeligheid wordt één rij gerapporteerd. De opwaartse nettocurvatuurrisicopositie van die risicofactor (CVRk+) of de neerwaartse nettocurvatuurrisicopositie van die risicofactor (CVRk-) zoals gespecificeerd in artikel 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013 worden in afzonderlijke rijen gerapporteerd. Alle waarden verwijzen naar de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (zoals gedefinieerd in afdeling 1, punt b), v), van bijlage V bij deze verordening). Instellingen rapporteren elke combinatie van portefeuille, instrumentnummer (kolom 0010), risico-identificatiecode (kolom 0020), subklasse (kolom 0030) en aanvullende identificatiecode (kolom 0040) slechts eenmaal.

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Portefeuille	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Nummer instrument	Bijlage V, afdeling 2	Het instrumentnummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0020	Identificatiecode risicofactor	Artikelen 325 terdecies, 325 quaterdecies, 325 quindecies, 325 sexdecies, 325 septdecies en 325 octodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013	De identificatiecode van de risicofactor zoals gespecificeerd in de tabel aan het einde van deze bijlage wordt gerapporteerd.
0030	Subklasse	Artikel 325 quinquies, lid 3, van Verordening (EU) nr. 575/2013	De subklasse wordt als volgt gerapporteerd. Wanneer de in kolom 0020 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met de risicoklasse: — “algemeen renterisico”, is het antwoord de naam van de valuta van de desbetreffende risicofactor “risicovrije rente”, “inflatierisco” of “cross-currencybasisrisico” (valuta-aanduiding volgens ISO 4217, bv. “EUR”); — “creditspreadrisico voor niet-securitisatie”, is het antwoord het nummer van de subklasse in artikel 325 quintricies, lid 1, tabel 4, van Verordening (EU) nr. 575/2013; — “creditspreadrisico voor securitisatie niet opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (non-ACHP CSR)”, is het antwoord het nummer van de subklasse in artikel 325 quadragies, lid 1, tabel 7, van die verordening; — “creditspreadrisico voor securitisatie opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (ACHP CSR)”, is het antwoord het nummer van de subklasse in artikel 325 octotricies, tabel 6, van die verordening; — “aandelenrisico”, is het antwoord het nummer van de subklasse in artikel 325 terquadragies, lid 1, tabel 8, van die verordening; — “grondstoffenrisico”, is het antwoord het nummer van de subklasse in artikel 325 sexquadragies, tabel 9, van die verordening; — “valutarisico en de delta- of curvatuurcomponenten”, is het antwoord de naam van de valuta (bv. “USD”; de valutacodes worden gerapporteerd volgens ISO 4217 valuta-aanduiding); — “valutarisico en de vega-component”, is het antwoord de naam van het valutapaar (bv. “EUR_USD”; de valutacodes worden gerapporteerd volgens de ISO 4217 valuta-aanduiding).
0040	Aanvullende identificator 1	Artikelen 325 terdecies t/m 325 octodecies en artikel 325 sextricies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Om de risicofactor binnen de subklassen te onderscheiden, wordt de volgende informatie gerapporteerd. Wanneer de in kolom 0020 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met de risicoklasse: — “algemeen renterisico en de deltacomponent”, is het antwoord de naam van de risicovrije curve of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode; — “creditspreadrisico voor niet-securitisatie of de risicoklasse creditspreadrisico voor securitisatie opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (ACHP CSR)”, is het antwoord de naam van de emittent of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode en is deze identiek voor alle twee gerapporteerde gevoeligheden voor twee risicofactoren die een correlatieparameter $\rho_{kl}^{(naam)}$ gelijk aan 1 krijgen overeenkomstig artikel 325 sextricies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013. — “creditspreadrisico voor securitisatie niet opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (non-ACHP CSR)”, is het antwoord de naam van de tranche of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode; — “aandelenrisico”, is het antwoord de naam van de emittent van de aandelen of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode;

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			— "grondstoffenrisico", is het antwoord de naam van de grondstof of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode. Wanneer geen van deze gevallen van toepassing is, rapporteren instellingen een expliciete waarde (NULL) als niet van toepassing.
0060	Risicogevoeligheid (resultaten rapportagevaluta)	Artikel 325 quinquies, lid 2, en de artikelen 325 octies, 325 novodecies, 325 vicies, 325 unvicies en325unquinquagies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Risicogevoeligheden (delta-/vegagevoeligheden en curvatuurrisicoposities) worden gerapporteerd op het niveau van elk instrument voor alle relevante risicofactoren zoals gespecificeerd in de kolommen 0020 tot en met 0040. De waarden worden gerapporteerd in de rapportagevaluta van de instelling. Wanneer de in kolom 0020 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met: — de deltarisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, wordt de nettogevoeligheid voor de risicofactor (S_k) gerapporteerd zoals gespecificeerd in artikel 325 novodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013. Wanneer instellingen, overeenkomstig artikel 325 unvicies, lid 5, van die verordening, van hun bevoegde autoriteit toestemming hebben gekregen om alternatieve berekeningen van deltarisicogevoeligheden te gebruiken, verwijzen zij voor de rapportage naar die alternatieve definities; — de vegarisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, wordt de vegarisicogevoeligheid van een optie voor een gegeven risicofactor (S_k) gerapporteerd zoals gespecificeerd in artikel 325 vicies van Verordening (EU) nr. 575/2013. Wanneer instellingen, overeenkomstig artikel 325 unvicies, lid 6, van die verordening, van hun bevoegde autoriteit toestemming hebben gekregen om alternatieve berekeningen van vegarisicogevoeligheden te gebruiken, verwijzen zij voor de rapportage naar die alternatieve berekeningen. Ongeacht of de instelling gebruikmaakt van de berekening van artikel 325 vicies of van een alternatieve berekening overeenkomstig artikel 325 unvicies, lid 6, van die verordening, wordt de gevoeligheid gerapporteerd na weging voor de overeenkomstige geïmpliceerde volatiliteit; — de curvatuurrisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, wordt de opwaartse nettocurvatuurrisicopositie van die risicofactor (CVR_k^+) of de neerwaartse nettocurvatuurrisicopositie van die risicofactor (CVR_k^-) gerapporteerd zoals gespecificeerd in artikel 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013. De gerapporteerde waarde wordt uitgedrukt als een getal met een nauwkeurigheid van minimaal twee cijfers na de komma. Nulwaarden mogen alleen worden gerapporteerd wanneer het resultaat van de berekening daadwerkelijk nul is.
0070	Rapportagevaluta		De naam van de rapportagevaluta van de instelling wordt gerapporteerd (de gerapporteerde waarde volgt de ISO 4217 valuta-aanduiding, bv. "EUR").
0080	Risicogevoeligheid (resultaten EBA-portefeuillevaluta)	Afdelingen 3 en 4 van bijlage V bij deze verordening Artikel 325 quinquies, lid 2, en de artikelen 325 octies, 325 novodecies, 325 vicies, 325 unvicies en325unquinquagies van Verordening (EU) nr. 575/2013	De waarden worden gerapporteerd volgens de instructies voor kolom 0060, maar omgerekend tegen de contante wisselkoers van de ECB voor de portefeuillevaluta als omschreven in de afdelingen 3 en 4 van bijlage V bij deze verordening.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0090	Risicogewicht	Deel drie, titel IV, hoofdstuk 1 bis, afdeling 6, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Het risicogewicht dat overeenstemt met de risicofactor zoals gespecificeerd in de kolommen 0020 tot en met 0040, wordt gerapporteerd. Wanneer de in kolom 0020 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met de component "curvatuurrisico", wordt het risicogewicht gerapporteerd dat wordt gebruikt om de toepasselijke relatieve verschuiving te bepalen. De gerapporteerde waarde wordt uitgedrukt als een getal met een nauwkeurigheid van minimaal vier cijfers na de komma.
0110	Aanvullende identificator 2	Artikel 325 septdecies, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de in kolom 0010 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met de risicoklasse "grondstoffenrisico" en de deltarisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, is het antwoord de reeks wettelijke voorwaarden betreffende de leveringsplaats of een andere overeenkomstige unieke identificatiecode. Wanneer geen van deze gevallen van toepassing is, rapporteren instellingen een expliciete waarde (NULL) als niet van toepassing.
0120	Kredietkwaliteits-categorie	Artikel 325 terdecies, lid 1, en artikel 325 quintricies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de in kolom 0010 geselecteerde identificatiecode van de risicofactor overeenkomt met de risicoklasse "creditspreadrisico voor niet-securitisaties" en de deltarisicocomponent van de op gevoeligheden gebaseerde methode, is het antwoord een van de volgende: (a) "CQS 1"; (b) "CQS 2"; (c) "CQS 3"; (d) "CQS 4"; (e) "CQS 5"; (f) "CQS 6"; (g) "Geen CQS toegekend (zonder rating)". Wanneer geen van deze gevallen van toepassing is, rapporteren instellingen een expliciete waarde (NULL) als niet van toepassing.

C 120.02 — SBM. OFR SAMENSTELLING PER PORTEFEUILLE

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Portefeuille	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Risicoklasse	Artikel 325 quinquies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013	De risicoklasse wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) "Algemeen renterisico (GIRR)"; (b) "Creditspreadrisico.CSR, niet-securitisaties" (creditspreadrisico (CSR) voor niet-securitisatie); (c) "Creditspreadrisico.Non-ACHP CSR" (creditspreadrisico voor securitisatie niet opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (non-ACTP CSR)); (d) "Creditspreadrisico.ACHP CSR" (creditspreadrisico voor securitisatie opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (ACTP CSR)); (e) "Aandelenrisico"; (f) "Grondstoffenrisico"; (g) "Valutarisico".
0020	Component	Artikel 325 sexies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013	De component van de op gevoeligheden gebaseerde methode wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) "deltarisico"; (b) "vegarisico"; (c) "curvatuurrisico".
0030	Correlatiescenario	Artikel 325 nonies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Het correlatiescenario wordt gerapporteerd. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) "medium-correlatie-scenario"; (b) "hoge-correlatie-scenario"; (c) "lage-correlatie-scenario".
0040	Eigenvermogensvereisten (resultaten rapportagevaluta)	Artikel 325 nonies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Voor elke portefeuille worden voor alle relevante combinaties van risicoklasse, component en correlatiescenario de waarden van de eigenvermogensvereisten (OFR) gerapporteerd voor de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (zoals gespecificeerd in afdeling 1, punt b), van bijlage V bij deze verordening). De waarden worden gerapporteerd in de rapportagevaluta van de instelling met een nauwkeurigheid van minimaal twee cijfers na de komma.
0050	Rapportagevaluta		De rapportagevaluta van de instelling wordt gerapporteerd (de gerapporteerde waarde volgt de ISO 4217 valuta-aanduiding).
0060	Eigenvermogensvereisten (resultaten EBA-portefeuillevaluta)	Afdelingen 3 en 4 van bijlage V bij deze verordening en artikel 325 nonies van Verordening (EU) nr. 575/2013	De waarden worden gerapporteerd volgens de instructies voor kolom 0040, maar omgerekend tegen de contante wisselkoers van de ECB voor de portefeuillevaluta als omschreven in de afdelingen 3 en 4 van bijlage V bij deze verordening.
0070	Aan eigenvermogensvereisten voor curvatuurrisico onderworpen posities zonder optionaliteit	Artikel 325 sexies, lid 3, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de component in kolom 0020 overeenkomt met het curvatuurrisico: (a) wordt "WAAR" gerapporteerd indien de instelling de benadering van artikel 325 sexies, lid 3, eerste alinea, van Verordening (EU) nr. 575/2013 toepast bij de berekening van het in de kolommen 0040 en 0060 gerapporteerde resultaat; (b) wordt "ONWAAR" gerapporteerd als dit niet het geval is. Wanneer geen van de bovenstaande gevallen van toepassing is, wordt ook "ONWAAR" gerapporteerd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0080	Basisvalutabenadering toegepast voor delta en curvatuur van het valutarisico	Artikel 325 octodecies, lid 7, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de risicoklasse in kolom 0010 overeenkomt met valutarisico en de component in kolom 0020 met deltarisico of curvatuurrisico: (a) wordt "WAAR" gerapporteerd indien de instelling de benadering van artikel 325 octodecies, lid 7, van Verordening (EU) nr. 575/2013 toepast bij de berekening van het in de kolommen 0040 en 0060 gerapporteerde resultaat; (b) wordt "ONWAAR" gerapporteerd als dit niet het geval is. Wanneer geen van de bovenstaande gevallen van toepassing is, wordt ook "ONWAAR" gerapporteerd.
0090	Verdeling van curvatuurrisicocomponenten voor valutarisico naar scalair	Artikel 325 octodecies, lid 6, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de risicoklasse in kolom 0010 overeenkomt met valutarisico en de component in kolom 0020 met curvatuurrisico: (a) wordt "WAAR" gerapporteerd indien de instelling de benadering van artikel 325 octodecies, lid 6, van Verordening (EU) nr. 575/2013 toepast bij de berekening van het in de kolommen 0040 en 0060 gerapporteerde resultaat; (b) wordt "ONWAAR" gerapporteerd als dit niet het geval is. Wanneer geen van de bovenstaande gevallen van toepassing is, wordt ook "ONWAAR" gerapporteerd.
0095	Indiening resultaten SBM-validatieportefeuille	Artikel 325 sexies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de portefeuille waarvoor informatie wordt gerapporteerd, een SBM-validatieportefeuille is als bedoeld in bijlage V, afdeling 7: a) wordt "Ingediend" gerapporteerd indien de instelling resultaten indient die aan deze portefeuille beantwoorden; b) wordt "Niet ingediend – geen blootstelling aan risicofactor" gerapporteerd indien de instelling ervoor kiest om geen resultaten voor de betrokken SBM-validatieportefeuille in te dienen, omdat er geen interne goedkeuring is van het management van die instelling om actief te zijn in instrumenten die blootstelling aan de betrokken risicofactor zouden genereren. "Niet van toepassing" wordt gerapporteerd wanneer de portefeuille waarvoor informatie wordt gerapporteerd, een portefeuille is als bedoeld in bijlage V, afdelingen 3, 4 of 5.
0100	Ruimte voor vrije tekst		Een instelling kan in deze kolom aanvullende informatie geven.

C 120.04 – DRC. MARKTWAARDEN EN BRUTO JTD-BEDRAGEN PER INSTRUMENT/PORTEFEUILLE

Instellingen rapporteren per instrument de blootstellingen die met het instrument overeenstemmen. Per blootstelling wordt één rij gerapporteerd. Alle waarden verwijzen naar de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (zoals gedefinieerd in afdeling 1, punt b), v), van bijlage V bij deze verordening). Blootstellingen worden gerapporteerd voordat enige verrekening heeft plaatsgevonden, maar na replicatie- of decompositiestappen (als gedefinieerd in de artikelen 325 septvicies en 325 tricies van Verordening (EU) nr. 575/2013), indien van toepassing.

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Portefeuille	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Nummer instrument	Bijlage V, afdeling 2	Het instrumentnummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.
0020	Risicoklasse	Artikel 325 tervicies, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Gerapporteerd wordt de risicoklasse waarvoor in de kolommen 0030 en 0040 het eigenvermogensvereiste voor het wanbetalingsrisico wordt gerapporteerd. Het antwoord is een van de volgende types instrumenten: (a) "andere instrumenten dan securitisatieposities"; (b) "niet in de ACHP opgenomen securitisatieposities"; (c) "in de ACHP opgenomen securitisatieposities".
0030	Subklasse 1	Artikel 325 sexvicies, lid 3, artikel 325 octovicies, lid 4, en artikel 325 untricies, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	De subklasse wordt gerapporteerd. Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met "niet-securitisaties", is het antwoord een van de volgende: (a) "corporates"; (b) "staten"; (c) "lokale overheden/gemeenten". Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse daarentegen overeenstemt met "niet in de ACHP opgenomen securitisaties", is het antwoord ofwel punt a) hierboven of een van de volgende: (d) "ABCP – Azië"; (e) "ABCP – Europa"; (f) "ABCP – Noord-Amerika"; (g) "ABCP – rest van de wereld"; (h) "autoleningen/-leases – Azië"; (i) "autoleningen/-leases – Europa"; (j) "autoleningen/-leases – Noord-Amerika"; (k) "autoleningen/-leases – rest van de wereld"; (l) "Collateralised debt obligations squared (CDO-squared) – Azië"; (m) "Collateralised debt obligations squared (CDO-squared) – Europa"; (n) "Collateralised debt obligations squared (CDO-squared) – Noord-Amerika"; (o) "Collateralised debt obligations squared (CDO-squared) – rest van de wereld"; (p) "Collateralised loan obligations – Azië"; (q) "Collateralised loan obligations – Europa"; (r) "Collateralised loan obligations – Noord-Amerika"; (s) "Collateralised loan obligations – rest van de wereld"; (t) "door hypotheken op zakelijk vastgoed gedekte effecten (CMBS) – Azië"; (u) "door hypotheken op zakelijk vastgoed gedekte effecten (CMBS) – Europa"; (v) "door hypotheken op zakelijk vastgoed gedekte effecten (CMBS) – Noord-Amerika"; (w) "door hypotheken op zakelijk vastgoed gedekte effecten (CMBS) – rest van de wereld"; (x) "kredietkaarten – Azië"; (y) "kredietkaarten – Europa"; (z) "kredietkaarten – Noord-Amerika"; (aa) "kredietkaarten – rest van de wereld"; (bb) "overige retail – Azië"; (cc) "overige retail – Europa"; (dd) "overige retail – Noord-Amerika";

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			(ee) "overige retail – rest van de wereld"; (ff) "overige wholesale – Azië"; (gg) "overige wholesale – Europa"; (hh) "overige wholesale – Noord-Amerika"; (ii) "overige wholesale – rest van de wereld"; (jj) "door hypotheken op niet-zakelijk vastgoed gedekte effecten (RMBS) – Azië"; (kk) "door hypotheken op niet-zakelijk vastgoed gedekte effecten (RMBS) – Europa"; (ll) "door hypotheken op niet-zakelijk vastgoed gedekte effecten (RMBS) – Noord-Amerika"; (mm) "door hypotheken op niet-zakelijk vastgoed gedekte effecten (RMBS) – rest van de wereld"; (nn) "kleine en middelgrote ondernemingen (kmo's) – Azië"; (oo) "kleine en middelgrote ondernemingen (kmo's) – Europa"; (pp) "kleine en middelgrote ondernemingen (kmo's) – Noord-Amerika"; (qq) "kleine en middelgrote ondernemingen (kmo's) – rest van de wereld"; (rr) "studieleningen – Azië"; (ss) "studieleningen – Europa"; (tt) "studieleningen – Noord-Amerika"; (uu) "studieleningen – rest van de wereld". Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse daarentegen overeenstemt met "in de ACHP opgenomen securitisaties", is het antwoord "in de ACHP opgenomen securitisaties".
0040	Subklasse 2	Artikel 325 untricies, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met "in de ACHP opgenomen securitisaties", is het antwoord de naam van de index; anders wordt (NIHIL) gerapporteerd.
0050	Debiteur	Artikel 325 tervicies, lid 2, artikel 325 quinvicies, lid 1, en de artikelen 325 septvicies en 325 tricies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Instellingen rapporteren informatie met betrekking tot de debiteur. Wanneer de in kolom 0020 geselecteerde risicoklasse overeenkomt met: — "andere instrumenten dan securitisatieposities", is het antwoord de naam van de debiteur; — "niet in de ACHP opgenomen securitisatieposities", is het antwoord de naam van de debiteur of een unieke identificatiecode die de onderliggende activapool en tranche aangeeft; — "in de ACHP opgenomen securitisatieposities", is het antwoord een unieke identificatiecode die de indexfamilie, -reeks en -tranche aangeeft.
0060	Kredietkwaliteits-categorie	Artikel 325 sexvicies, leden 1 en 2, artikel 325 octovicies, lid 1, en artikel 325 untricies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Instellingen rapporteren de kredietkwaliteit. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) "CQS 1"; (b) "CQS 2"; (c) "CQS 3"; (d) "CQS 4"; (e) "CQS 5"; (f) "CQS 6"; (g) "Geen CQS toegekend (zonder rating)";

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			(h) "Geen CQS toegekend (in wanbetaling)"; (i) "Geen CQS toegekend (risicogewicht van 0 %)". Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met "in de ACHP opgenomen securitisaties" of "niet in de ACHP opgenomen securitisaties", is het antwoord een van de bovenstaande of volgende: (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 andere".
0070	Wanbetalingsrisicogewicht	Artikel 325 tervicies, lid 1, punt f), artikel 325 sexvicies, leden 1 en 2, artikel 325 octovicies, lid 1, en artikel 325 untricies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Instellingen rapporteren het relevante risicogewicht. Op securitisatieblootstellingen toegepaste risicogewichten worden gerapporteerd na vermenigvuldiging met 8 % overeenkomstig artikel 325 octovicies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013.
0080	Rang	Artikel 325 quatervicies, leden 3 en 6, van Verordening (EU) nr. 575/2013	De rang van de blootstelling wordt gerapporteerd. Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met "andere instrumenten dan securitisatieposities" of "niet in de ACHP opgenomen securitisaties", is het antwoord een van de volgende: (a) "eigenvermogensinstrumenten": (b) "achtergestelde schuldinstrumenten"; (c) "niet-achtergestelde schuldinstrumenten"; (d) "gedekte obligaties". Wanneer geen van de bovenstaande gevallen van toepassing is, wordt de cel blanco gelaten.
0090	Looptijd	Artikelen 325 quinvicies, 325 septvicies en 325 tricies van Verordening (EU) nr. 575/2013	De vervaldatum van de blootstelling wordt gerapporteerd. Voor het rapporteren van de datum wordt de "dd/mm/jjjj"-conventie gebruikt.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0100	Inningspercentage	Artikel 325 tervicies, lid 1, punt e), van Verordening (EU) nr. 575/2013	Instellingen rapporteren het inningspercentage. Het inningspercentage wordt berekend aan de hand van het toepasselijke verlies bij wanbetaling (loss given default – "LGD") als inningspercentage = 1 - LGD. Het gerapporteerde inningspercentage wordt uitgedrukt als een getal tussen 0 en 1, met een nauwkeurigheid van minimaal vier cijfers na de komma.
0110	Richting	Artikel 325 tervicies, lid 1, punten a) en b), van Verordening (EU) nr. 575/2013	Instellingen rapporteren de richting van de blootstelling overeenkomstig de definities van artikel 325 tervicies, lid 1, punten a) en b), van Verordening (EU) nr. 575/2013. Uit een van de volgende antwoorden te kiezen: (a) "shortblootstelling"; (b) "longblootstelling".
0120	Attachment point (%)	Artikelen 325 octovicies en 325 untricies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de gerapporteerde blootstelling betrekking heeft op een tranche, rapporteren de instellingen het attachment point van de tranche. De gerapporteerde waarde wordt uitgedrukt als een getal met een nauwkeurigheid van minimaal vier cijfers na de komma.
0130	Detachment point (%)	Artikelen 325 octovicies en 325 untricies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de gerapporteerde blootstelling betrekking heeft op een tranche, rapporteren de instellingen het detachment point van de tranche. De gerapporteerde waarde wordt uitgedrukt als een getal met een nauwkeurigheid van minimaal vier cijfers na de komma.
0140-0170	Resultaten rapportagevaluta		De waarden worden gerapporteerd in de rapportagevaluta van de instelling, met een nauwkeurigheid van minimaal twee cijfers na de komma, in voorkomend geval.
0140	Notional	Artikel 325 quatervicies, leden 1, 2 en 5, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met "andere instrumenten dan securitisatieposities", rapporteren de instellingen het notionele bedrag van het instrument. De waarde komt overeen met de term $V_{notional}$ in artikel 325 quatervicies, leden 1 en 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013 of de term V in artikel 325 quatervicies, lid 5, van die verordening, afhankelijk van het soort blootstelling. Wanneer geen van de bovengenoemde gevallen van toepassing is of de instelling het in deze kolom te rapporteren bedrag niet uitdrukkelijk berekent of gebruikt om het bruto jump-to-default-bedrag ("JTD-bedrag") te schatten, wordt de cel blanco gelaten.
0150	P&L + Adjustment	Artikel 325 quatervicies, leden 1, 2 en 5, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Instellingen rapporteren voor elke blootstelling de som van P&L en Adjustment: — Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met "andere instrumenten dan securitisatieposities" en de gerapporteerde blootstelling een longblootstelling is, rapporteren de instellingen de som van $P\&L_{long}$ en $Adjustment_{long}$ overeenkomstig artikel 325 quatervicies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013. — Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met "andere instrumenten dan securitisatieposities" en de gerapporteerde blootstelling een shortblootstelling is, rapporteren instellingen de som van $P\&L_{short}$ en $Adjustment_{short}$ overeenkomstig artikel 325 quatervicies, lid 2, van die verordening.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			Wanneer geen van de bovengenoemde gevallen van toepassing is of de instelling het in deze kolom te rapporteren bedrag niet uitdrukkelijk berekent of gebruikt om het bruto JTD-bedrag te schatten, wordt de cel blanco gelaten.
0160	Bruto JTD-bedrag	Artikel 325 tervicies, lid 1, punt c), artikel 325 quatervicies, leden 1, 2 en 5, artikel 325 septvicies, lid 1, en artikel 325 tricies, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Instellingen rapporteren het bruto JTD-bedrag voor de specifieke blootstelling.
0170	Valuta		De rapportagevaluta van de instelling wordt gerapporteerd (de gerapporteerde waarde volgt de ISO 4217 valuta-aanduiding).
0180-0200	Resultaten EBA-portefeuillevaluta	Afdelingen 3 en 4 van bijlage V bij deze verordening en de artikelen 325 sexvicies, 325 octovicies en 325 untricies van Verordening (EU) nr. 575/2013	De waarden worden gerapporteerd volgens de instructies voor kolom 0030, maar omgerekend tegen de contante wisselkoers van de ECB voor de portefeuillevaluta als omschreven in de afdelingen 3 en 4 van bijlage V bij deze verordening.
0180	Notional	Artikel 325 quatervicies, leden 1, 2 en 5, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met “andere instrumenten dan securitisatieposities”, rapporteren de instellingen het notionele bedrag van het instrument. De waarde komt overeen met de term $V_{notional}$ in artikel 325 quatervicies, leden 1 en 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013 of de term V in artikel 325 quatervicies, lid 5, van die verordening, afhankelijk van het soort blootstelling. Wanneer geen van de bovengenoemde gevallen van toepassing is of de instelling het in deze kolom te rapporteren bedrag niet uitdrukkelijk berekent of gebruikt om het bruto JTD-bedrag te schatten, wordt de cel blanco gelaten.
0190	P&L + Adjustment	Artikel 325 quatervicies, leden 1, 2 en 5, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Instellingen rapporteren voor elke blootstelling de som van P&L en Adjustment: — Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met “andere instrumenten dan securitisatieposities” en de gerapporteerde blootstelling een longblootstelling is, rapporteren de instellingen de som van $P\&L_{long}$ en $Adjustment_{long}$ overeenkomstig artikel 325 quatervicies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013. — Wanneer de in kolom 0020 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met “andere instrumenten dan securitisatieposities” en de gerapporteerde blootstelling een shortblootstelling is, rapporteren de instellingen de som van $P\&L_{short}$ en $Adjustment_{short}$ overeenkomstig artikel 325 quatervicies, lid 2, van die verordening.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			Wanneer geen van de bovengenoemde gevallen van toepassing is of de instelling het in deze kolom te rapporteren bedrag niet uitdrukkelijk berekent of gebruikt om het bruto JTD-bedrag te schatten, wordt de cel blanco gelaten.
0200	Bruto JTD-bedrag	Artikel 325 tervicies, lid 1, punt c), artikel 325 quatervicies, leden 1, 2 en 5, artikel 325 septvicies, lid 1, en artikel 325 tricies, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Instellingen rapporteren het bruto jump-to-default-bedrag (JTD-bedrag) voor de specifieke blootstelling.

C 120.05 – DRC. OFR SAMENSTELLING PER PORTEFEUILLE

Instructies betreffende bladen (z-as)

Label	Rechtsgrondslag	Instructies
Portefeuille	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Risicoklasse	Artikel 325 tervicies, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Gerapporteerd wordt de risicoklasse waarvoor in de kolommen 0030 en 0040 de eigenvermogensvereisten voor het wanbetalingsrisico worden gerapporteerd. Het antwoord is een van de volgende types instrumenten: (a) “andere instrumenten dan securitisatieposities”; (b) “niet in de ACHP opgenomen securitisatieposities”; (c) “in de ACHP opgenomen securitisatieposities”;
0020	Subklasse 1	Artikel 325 sexvicies, lid 3, artikel 325 octovicies, lid 4, en artikel 325 untricies, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	De subklasse wordt gerapporteerd. Wanneer de in kolom 0010 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met “andere instrumenten dan securitisatieposities”, is het antwoord een van de volgende: (a) “corporates”; (b) “staten”; (c) “lokale overheden/gemeenten”.

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			Wanneer de in kolom 0010 gerapporteerde risicoklasse daarentegen overeenstemt met "niet in de ACHP opgenomen securitisatieposities", is het antwoord een van de volgende: (d) "ABCP – Azië"; (e) "ABCP – Europa"; (f) "ABCP – Noord-Amerika"; (g) "ABCP – rest van de wereld"; (h) "autoleningen/-leases – Azië"; (i) "autoleningen/-leases – Europa"; (j) "autoleningen/-leases – Noord-Amerika"; (k) "autoleningen/-leases – rest van de wereld"; (l) "Collateralised debt obligations squared (CDO-squared) – Azië"; (m) "Collateralised debt obligations squared (CDO-squared) – Europa"; (n) "Collateralised debt obligations squared (CDO-squared) – Noord-Amerika"; (o) "Collateralised debt obligations squared (CDO-squared) – rest van de wereld"; (p) "Collateralised loan obligations – Azië"; (q) "Collateralised loan obligations – Europa"; (r) "Collateralised loan obligations – Noord-Amerika"; (s) "Collateralised loan obligations – rest van de wereld"; (t) "door hypotheken op zakelijk vastgoed gedekte effecten (CMBS) – Azië"; (u) "door hypotheken op zakelijk vastgoed gedekte effecten (CMBS) – Europa"; (v) "door hypotheken op zakelijk vastgoed gedekte effecten (CMBS) – Noord-Amerika"; (w) "door hypotheken op zakelijk vastgoed gedekte effecten (CMBS) – rest van de wereld"; (x) "kredietkaarten – Azië"; (y) "kredietkaarten – Europa"; (z) "kredietkaarten – Noord-Amerika"; (aa) "kredietkaarten – rest van de wereld"; (bb) "overige retail – Azië"; (cc) "overige retail – Europa"; (dd) "overige retail – Noord-Amerika"; (ee) "overige retail – rest van de wereld"; (ff) "overige wholesale – Azië"; (gg) "overige wholesale – Europa"; (hh) "overige wholesale – Noord-Amerika"; (ii) "overige wholesale – rest van de wereld"; (jj) "door hypotheken op niet-zakelijk vastgoed gedekte effecten (RMBS) – Azië"; (kk) "door hypotheken op niet-zakelijk vastgoed gedekte effecten (RMBS) – Europa"; (ll) "door hypotheken op niet-zakelijk vastgoed gedekte effecten (RMBS) – Noord-Amerika"; (mm) "door hypotheken op niet-zakelijk vastgoed gedekte effecten (RMBS) – rest van de wereld"; (nn) "kleine en middelgrote ondernemingen (kmo's) – Azië"; (oo) "kleine en middelgrote ondernemingen (kmo's) – Europa"; (pp) "kleine en middelgrote ondernemingen (kmo's) – Noord-Amerika"; (qq) "kleine en middelgrote ondernemingen (kmo's) – rest van de wereld"; (rr) "studieleningen – Azië";

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
			(ss) "studieleningen – Europa"; (tt) "studieleningen – Noord-Amerika"; (uu) "studieleningen – rest van de wereld". Wanneer de in kolom 0010 gerapporteerde risicoklasse daarentegen overeenstemt met "in de ACHP opgenomen securitisatieposities", is het antwoord "in de ACHP opgenomen securitisaties".
0030	Subklasse 2	Artikel 325 untricies, lid 2, van Verordening (EU) nr. 575/2013	Wanneer de in kolom 0010 gerapporteerde risicoklasse overeenstemt met "in de ACHP opgenomen securitisatieposities", is het antwoord de naam van de index; anders wordt (NIHIL) gerapporteerd.
0040	Eigenvermogens-vereisten (resultaten rapportagevaluta)	Artikelen 325 sexvicies, 325 octovicies en 325 untricies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Eigenvermogensvereisten (OFR) voor wanbetalingsrisico worden gerapporteerd voor de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (zoals gespecificeerd in afdeling 1, punt b), van bijlage V bij deze verordening). De waarden worden gerapporteerd in de rapportagevaluta van de instelling met een nauwkeurigheid van minimaal twee cijfers na de komma.
0050	Rapportagevaluta		De rapportagevaluta van de instelling wordt gerapporteerd (de gerapporteerde waarde volgt de ISO 4217 valuta-aanduiding).
0060	Eigenvermogens-vereisten (resultaten EBA-portefeuillevaluta)	Afdelingen 3 en 4 van bijlage V bij deze verordening en de artikelen 325 sexvicies, 325 octovicies en 325 untricies van Verordening (EU) nr. 575/2013	De waarden worden gerapporteerd volgens de instructies voor kolom 0030, maar omgerekend tegen de contante wisselkoers van de ECB voor de portefeuillevaluta als omschreven in de afdelingen 3 en 4 van bijlage V bij deze verordening.

C 120.06 – ASA. OFR

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0010	Portefeuillenum-mer	Bijlage V, afdelingen 3, 4 en 5	Het portefeuillenummer uit bijlage V wordt gerapporteerd.
0020-0040	Resultaten rapportagevaluta	Bijlage V, afdelingen 3 en 4	

Kolom	Label	Rechtsgrondslag	Instructies
0020	SBM OFR	Artikel 325 nonies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Voor elke portefeuille worden de eigenvermogensvereisten (OFR) voor de op gevoeligheden gebaseerde methode van de alternatieve standaardbenadering gerapporteerd voor de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (zoals gespecificeerd in afdeling 1, punt b), van bijlage V bij deze Verordening).
0030	DRC OFR	Artikel 325 tervicies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Voor elke portefeuille worden de eigenvermogensvereisten (OFR) voor het wanbetalingsrisico in het kader van de alternatieve standaardbenadering gerapporteerd voor de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (zoals gespecificeerd in afdeling 1, punt b), van bijlage V bij deze Verordening).
0040	RRAO OFR	Artikel 325 duovicies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Voor elke portefeuille worden de eigenvermogensvereisten (OFR) voor de opslagfactor voor restrisico in het kader van de alternatieve standaardbenadering gerapporteerd voor de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (zoals gespecificeerd in afdeling 1, punt b), van bijlage V bij deze Verordening).
0050-0070	Resultaten EBA-portefeuillevaluta	Bijlage V, afdelingen 3 en 4	Wanneer de rapportagevaluta van de instelling verschilt van de in afdelingen 3 en 4 van bijlage V bij deze verordening gespecificeerde EBA-portefeuillevaluta, rekenen de instellingen de rapportagevaluta om tegen de toepasselijke contante wisselkoers van de ECB.
0050	SBM OFR	Artikel 325 nonies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Voor elke portefeuille worden de eigenvermogensvereisten (OFR) voor de op gevoeligheden gebaseerde methode van de alternatieve standaardbenadering gerapporteerd voor de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (zoals gespecificeerd in afdeling 1, punt b), van bijlage V bij deze Verordening).
0060	DRC OFR	Artikel 325 tervicies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Voor elke portefeuille worden de eigenvermogensvereisten (OFR) voor het wanbetalingsrisico in het kader van de alternatieve standaardbenadering gerapporteerd voor de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (zoals gespecificeerd in afdeling 1, punt b), van bijlage V bij deze Verordening).
0070	RRAO OFR	Artikel 325 duovicies van Verordening (EU) nr. 575/2013	Voor elke portefeuille worden de eigenvermogensvereisten (OFR) voor de opslagfactor voor restrisico in het kader van de alternatieve standaardbenadering gerapporteerd voor de "RM- (en eind-ASA) eindreferentiedatum" (zoals gespecificeerd in afdeling 1, punt b), van bijlage V bij deze Verordening).

Tabel: Instructies voor de rapportage in de templates 106.01 (kolom 0010) en 120.01 (kolom 0020)

— De kolom "risicoklasse" verwijst naar artikel 325 quinquies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013. Om de risicoklassen aan te duiden, worden de volgende afkortingen gebruikt:

a) "GIRR" (algemeen renterisico);

b) "CSR_NON_SEC" (creditspreadrisico (CSR) voor niet-securitisatie);

c) "CSR_SEC_NON_ACTP" (creditspreadrisico voor securitisatie niet opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (niet-ACHP CSR));

d) "CSR_SEC_ACTP" (creditspreadrisico voor securitisatie opgenomen in de alternatieve correlatiehandelsportefeuille (ACHP CSR));

e) "EQ" (aandelenrisico);

f) "CM" (grondstoffenrisico);

g) "FX" (valutarisico).

— De kolom "component" verwijst naar artikel 325 sexies, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013. Om de componenten van de op gevoeligheden gebaseerde methode aan te duiden, worden de volgende afkortingen gebruikt:

a) "DELTA" (deltarisico);

b) "VEGA" (vegarisico);

c) "CURVATURE" (curvatuurrisico).

— De kolom "looptijd" verwijst naar de looptijd van de risicofactor, waarbij risicofactoren worden gedefinieerd langs gespecificeerde vertices volgens de artikelen 325 terdecies, 325 quaterdecies, 325 quindecies, 325 sexdecies, 325 septdecies en 325 octodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013. Voor vega algemene-renterisicofactoren zoals gespecificeerd in artikel 325 terdecies, lid 7, van die verordening worden twee door een koppelteken gescheiden looptijden gegeven (bv. "0,5 jaar - 0,5 jaar"), waarbij de eerste betrekking heeft op de looptijd van de optie en de tweede op de resterende looptijd van de onderliggende waarde van de optie op de vervaldatum van de optie.

— De kolom "aanvullende specificaties" geeft een verdere specificatie van de respectieve risicofactor met betrekking tot het onderscheid tussen inflatie- en cross-currencybasis-risicofactoren overeenkomstig artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013, het onderscheid tussen risicofactoren met betrekking tot schuldinstrumenten en risicofactoren in verband met kredietverzuimswaps overeenkomstig de artikelen 325 quaterdecies en 325 quindecies van die verordening, het onderscheid tussen "equity spot price"- en "equity repo rate"-risicofactoren overeenkomstig artikel 325 sexdecies van die verordening en het onderscheid tussen de opwaartse nettocurvatuurrisicopositie van die risicofactor (CVRk+) en de neerwaartse nettocurvatuurrisicopositie van die risicofactor (CVRk-) zoals gespecificeerd in artikel 325 octies van die verordening.

Risicoklasse	Component	Looptijd	Aanvullende specificatie	Identificatiecode risicofactor	Rechtsgrondslag
CM	DELTA	0 jaar		CM_D_00.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	0,25 jaar		CM_D_00.25	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	0,5 jaar		CM_D_00.50	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	1 jaar		CM_D_01.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	2 jaar		CM_D_02.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	3 jaar		CM_D_03.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	5 jaar		CM_D_05.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	10 jaar		CM_D_10.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	15 jaar		CM_D_15.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	20 jaar		CM_D_20.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	DELTA	30 jaar		CM_D_30.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	VEGA	0,5 jaar		CM_V_00.50	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	VEGA	1 jaar		CM_V_01.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	VEGA	3 jaar		CM_V_03.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	VEGA	5 jaar		CM_V_05.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	VEGA	10 jaar		CM_V_10.00	Artikel 325 septdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CM	CURVATURE		Opwaartse verschuiving	CM_CU	Artikelen 325 septdecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013

Risicoklasse	Component	Looptijd	Aanvullende specificatie	Identificatiecode risicofactor	Rechtsgrondslag
CM	CURVATURE		Neerwaartse verschuiving	CM_CD	Artikelen 325 septdecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 jaar	Schuldinstrument	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 jaar	Schuldinstrument	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 jaar	Schuldinstrument	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 jaar	Schuldinstrument	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 jaar	Schuldinstrument	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 jaar		CSR_NON_SEC_V_00.50	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	1 jaar		CSR_NON_SEC_V_01.00	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	3 jaar		CSR_NON_SEC_V_03.00	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	5 jaar		CSR_NON_SEC_V_05.00	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	10 jaar		CSR_NON_SEC_V_10.00	Artikel 325 quaterdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Opwaartse verschuiving	CSR_NON_SEC_CU	Artikelen 325 quaterdecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013

Risicoklasse	Component	Looptijd	Aanvullende specificatie	Identificatiecode risicofactor	Rechtsgrondslag
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Neerwaartse verschuiving	CSR_NON_SEC_CD	Artikelen 325 quaterdecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 jaar	Schuldinstrument	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 jaar	Schuldinstrument	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 jaar	Schuldinstrument	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 jaar	Schuldinstrument	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 jaar	Schuldinstrument	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 jaar		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 jaar		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 jaar		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 jaar		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 jaar		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Opwaartse verschuiving	CSR_SEC_ACTP_CU	Artikelen 325 quindecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013

Risicoklasse	Component	Looptijd	Aanvullende specificatie	Identificatiecode risicofactor	Rechtsgrondslag
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Neerwaartse verschuiving	CSR_SEC_ACTP_CD	Artikelen 325 quindecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	0,5 jaar	Schuldinstrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_DEBT	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	1 jaar	Schuldinstrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_DEBT	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	3 jaar	Schuldinstrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_DEBT	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	5 jaar	Schuldinstrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_DEBT	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	10 jaar	Schuldinstrument	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	0,5 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	1 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	3 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	5 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	10 jaar	Kredietverzuimswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	0,5 jaar		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	1 jaar		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	3 jaar		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	5 jaar		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	10 jaar		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Artikel 325 quindecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE		Opwaartse verschuiving	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Artikelen 325 quindecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013

Risicoklasse	Component	Looptijd	Aanvullende specificatie	Identificatiecode risicofactor	Rechtsgrondslag
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE		Neerwaartse verschuiving	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Artikelen 325 quindecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013
EQ	DELTA		Contante koers	EQ_D_SPOT	Artikel 325 sexdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
EQ	DELTA		Repo rate	EQ_D_REPO	Artikel 325 sexdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
EQ	VEGA	0,5 jaar		EQ_V_00.50	Artikel 325 sexdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
EQ	VEGA	1 jaar		EQ_V_01.00	Artikel 325 sexdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
EQ	VEGA	3 jaar		EQ_V_03.00	Artikel 325 sexdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
EQ	VEGA	5 jaar		EQ_V_05.00	Artikel 325 sexdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
EQ	VEGA	10 jaar		EQ_V_10.00	Artikel 325 sexdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
EQ	CURVATURE		Opwaartse verschuiving	EQ_CU	Artikelen 325 sexdecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013
EQ	CURVATURE		Neerwaartse verschuiving	EQ_CD	Artikelen 325 sexdecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013
FX	DELTA			FX_D	Artikel 325 octodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
FX	VEGA	0,5 jaar		FX_V_00.50	Artikel 325 octodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
FX	VEGA	1 jaar		FX_V_01.00	Artikel 325 octodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
FX	VEGA	3 jaar		FX_V_03.00	Artikel 325 octodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
FX	VEGA	5 jaar		FX_V_05.00	Artikel 325 octodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
FX	VEGA	10 jaar		FX_V_10.00	Artikel 325 octodecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
FX	CURVATURE		Opwaartse verschuiving	FX_CU	Artikelen 325 octodecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013

Risicoklasse	Component	Looptijd	Aanvullende specificatie	Identificatiecode risicofactor	Rechtsgrondslag
FX	CURVATURE		Neerwaartse verschuiving	FX_CD	Artikelen 325 octodecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	0,25 jaar		GIRR_D_00.25	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	0,5 jaar		GIRR_D_00.50	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	1 jaar		GIRR_D_01.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	2 jaar		GIRR_D_02.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	3 jaar		GIRR_D_03.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	5 jaar		GIRR_D_05.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	10 jaar		GIRR_D_10.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	15 jaar		GIRR_D_15.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	20 jaar		GIRR_D_20.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA	30 jaar		GIRR_D_30.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Inflatie	GIRR_D_INF	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Cross-currencybasis (tegenover EUR)	GIRR_D_CRO_EUR	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Cross-currencybasis (tegenover USD)	GIRR_D_CRO_USD	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 jaar - 0,5 jaar		GIRR_V_00.50_00.50	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 jaar - 0,5 jaar		GIRR_V_01.00_00.50	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 jaar - 0,5 jaar		GIRR_V_03.00_00.50	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013

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

Risicoklasse	Component	Looptijd	Aanvullende specificatie	Identificatiecode risicofactor	Rechtsgrondslag
GIRR	VEGA	5 jaar - 0,5 jaar		GIRR_V_05.00_00.50	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 jaar - 0,5 jaar		GIRR_V_10.00_00.50	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 jaar - 1 jaar		GIRR_V_00.50_01.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 jaar - 1 jaar		GIRR_V_01.00_01.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 jaar - 1 jaar		GIRR_V_03.00_01.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 jaar - 1 jaar		GIRR_V_05.00_01.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 jaar - 1 jaar		GIRR_V_10.00_01.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 jaar - 3 jaar		GIRR_V_00.50_03.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 jaar - 3 jaar		GIRR_V_01.00_03.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 jaar - 3 jaar		GIRR_V_03.00_03.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 jaar - 3 jaar		GIRR_V_05.00_03.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 jaar - 3 jaar		GIRR_V_10.00_03.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 jaar - 5 jaar		GIRR_V_00.50_05.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 jaar - 5 jaar		GIRR_V_01.00_05.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 jaar - 5 jaar		GIRR_V_03.00_05.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 jaar - 5 jaar		GIRR_V_05.00_05.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 jaar - 5 jaar		GIRR_V_10.00_05.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013

Risicoklasse	Component	Looptijd	Aanvullende specificatie	Identificatiecode risicofactor	Rechtsgrondslag
GIRR	VEGA	0,5 jaar - 10 jaar		GIRR_V_00.50_10.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 jaar - 10 jaar		GIRR_V_01.00_10.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 jaar - 10 jaar		GIRR_V_03.00_10.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 jaar - 10 jaar		GIRR_V_05.00_10.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 jaar - 10 jaar		GIRR_V_10.00_10.00	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 jaar	Inflatie	GIRR_V_00.50_INF	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 jaar	Inflatie	GIRR_V_01.00_INF	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 jaar	Inflatie	GIRR_V_03.00_INF	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 jaar	Inflatie	GIRR_V_05.00_INF	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 jaar	Inflatie	GIRR_V_10.00_INF	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 jaar	Cross-currencybasis (tegenover EUR)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 jaar	Cross-currencybasis (tegenover EUR)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 jaar	Cross-currencybasis (tegenover EUR)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 jaar	Cross-currencybasis (tegenover EUR)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 jaar	Cross-currencybasis (tegenover EUR)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 jaar	Cross-currencybasis (tegenover USD)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 jaar	Cross-currencybasis (tegenover USD)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013

Risicoklasse	Component	Looptijd	Aanvullende specificatie	Identificatiecode risicofactor	Rechtsgrondslag
GIRR	VEGA	3 jaar	Cross-currencybasis (tegenover USD)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 jaar	Cross-currencybasis (tegenover USD)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 jaar	Cross-currencybasis (tegenover USD)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Artikel 325 terdecies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Opwaartse verschuiving	GIRR_CU	Artikelen 325 terdecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Neerwaartse verschuiving	GIRR_CD	Artikelen 325 terdecies en 325 octies van Verordening (EU) nr. 575/2013”

ANNEX IV

„BIJLAGE VII

Resultaten benchmarkportefeuilles t.b.v. toezicht MARKTRISICO

RESULTATEN BENCHMARKINGPORTEFEUILLES. MARKTRISICO			
Templatenummer	**Code template**	**Naam template/groep templates**	**Korte naam**
		EERSTE MARKTWAARDERING	
106,1	C 106.00	EERSTE MARKTWAARDERING EN RECHTVAARDIGING UITSLUITING	IMV
106,2	C 106.01	RISICOGEVOELIGHEDEN PER INSTRUMENT	GEVOELIGHEDEN
		VaR, sVaR en PV	
107,1	C 107.01	NADERE BIJZONDERHEDEN	VaR&sVaR 1
107,2	C 107.02	RESULTATEN **EBA-PORTEFEUILLE**VALUTA	VaR&sVaR 2
		WINST & VERLIES (P&L)-TIJDREEKSEN	
108	C 108.00	WINST & VERLIES (P&L)-TIJDREEKSEN	P&L
		VEREISTE VOOR INCREMENTEEL RISICO	
109,1	C 109.01	IRC. NADERE BIJZONDERHEDEN MODEL	IRC 1
109,2	C 109.02	IRC. NADERE BIJZONDERHEDEN PER PORTEFEUILLE	IRC 2
109,3	C 109.03	IRC. BEDRAG PER PORTEFEUILLE/DATUM	IRC 3
		CORRELATIEHANDEL	
110,1	C 110.01	CT. NADERE BIJZONDERHEDEN VAN HET MODEL	CT 1
110,2	C 110.02	CT. NADERE BIJZONDERHEDEN PER PORTEFEUILLE	IRC 2
110,3	C 110.03	CT. BEDRAG PER PORTEFEUILLE/DATUM	CT 3
		ASA (SBM & DRC)	
120,1	C 120.01	SBM. RISICOGEVOELIGHEDEN PER INSTRUMENT/PORTEFEUILLE	SBM 1
120,2	C 120.02	SBM. OFR SAMENSTELLING PER PORTEFEUILLE	SBM 2
120,4	C 120.04	DRC. MARKTWAARDEN EN BRUTO JTD-BEDRAGEN PER INSTRUMENT/PORTEFEUILLE	DRC 1
120,5	C 120.05	DRC. OFR SAMENSTELLING PER PORTEFEUILLE	DRC 2
120,6	C 120.06	ASA. OFR PER PORTEFEUILLE	ASA OFR

C 106.00 – EERSTE MARKTWAARDERING EN RECHTVAARDIGING UITSLUITING

Nummer instrument	Instrument gemodelleerd voor VaR en sVaR (Waar/Onwaar)	Instrument gemodelleerd voor IRC (Waar/Onwaar)	Instrument gemodelleerd voor correlatiehandel (Waar/Onwaar)	Reden voor uitsluiting	Ruimte voor vrije tekst	Eerste marktwaardering
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 106.01 – RISICOGEVOELIGHEDEN PER INSTRUMENT

Nummer instrument

Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Risicogevoeligheid (resultaten rapportageva-luta)	Rapportageva-luta	Risicogevoeligheid (resultaten EBA-instrumentvaluta)	Prijsmodel	Definitie gevoeligheden	Ruimte voor vrije tekst	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

C 107.01 - VaR, sVaR en PV. NADERE BIJZONDERHEDEN

		Optie	Ruimte voor vrije tekst
		0010	0020
VaR			
0010	**Methodologie**		
0020	**Berekening 10-daagse horizon**		

		Optie	Ruimte voor vrije tekst
		0010	0020
0030	**Lengte observatieperiode**		
0040	**Weging data**		
0050	**Opslagfactor backtesting**		
0060	**VaR-opslagfactor op grond van regelgeving**		
sVaR			
0070	**Methodologie**		
0080	**Berekening 10-daagse horizon**		
0090	**sVaR-opslagfactor op grond van regelgeving**		
0100	**sVaR-periode**		

C 107.02 - VaR en sVaR NON-CTP. RESULTATEN EBA-PORTEFEUILLEVALUTA

Portefeuille

Datum	VaR	sVaR	PV
0010	0020	0030	0040

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

PB L van 12.3.2025

C 108.00 – WINST & VERLIES (P&L)-TIJDREEKSEN

Portefeuille

Datum	**Dagelijkse P&L**
0010	0020

C 109.01 - IRC. NADERE BIJZONDERHEDEN MODEL

		Optie	**Ruimte voor vrije tekst**
Rij	**Post**	0010	0020
0010	**Aantal modellerende factoren**		
0020	**Bron LGD's**		

C 109.02 - IRC. NADERE BIJZONDERHEDEN PER PORTEFEUILLE

Portefeuille

		Optie	Ruimte voor vrije tekst
Rij	**Post**	0010	0020
0010	**Liquiditeitshorizon**		
0020	**Bron PD's**		
0030	**Bron overgangsmatrices**		

C 109.03 - IRC. BEDRAG PER PORTEFEUILLE/DATUM

Portefeuille

Datum	IRC
0010	0020

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

C 110.01 – CT. NADERE BIJZONDERHEDEN VAN HET MODEL

		Optie	Ruimte voor vrije tekst
Rij	**Post**	0010	0020
0010	**Aantal modellerende factoren**		
0020	**Bron LGD's**		

C 110.02 – CT. NADERE BIJZONDERHEDEN PER PORTEFEUILLE

Portefeuille

		Optie	Ruimte voor vrije tekst
Rij	**Post**	0010	0020
0010	**Liquiditeitshorizon**		
0020	**Bron PD's**		
0030	**Bron overgangsmatrices**		

C 110.03 – CT. APR PER PORTEFEUILLE/DATUM

Portefeuille

Datum	**APR**
0010	0060

C 120.01 — SBM. RISICOGEVOELIGHEDEN PER INSTRUMENT/PORTEFEUILLE

Portefeuille

Nummer instrument	**Identificator risicofactor**	**Subklasse**	**Aanvullende identificator**	**Risicogevoeligheid (Resultaten rapportagevaluta)**	**Rapportagevaluta**	**Risicogevoeligheid (Resultaten EBA-portefeuillevaluta)**	**Risicogewicht**	**Aanvullende identificator 2**	**Kredietkwaliteitscategorie**
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 SAMENSTELLING PER PORTEFEUILLE

Portefeuille

Risicoklasse	Risicocomponent	Correlatiescenario	Eigenvermogensvereisten (resultaten rapportagevaluta)	Rapportagevaluta	Eigenvermogensvereisten (resultaten EBA-portefeuillevaluta)	Aan eigenvermogensvereisten voor curvatuurrisico onderworpen posities zonder optionaliteit	Op delta en curvatuur van wisselkoersrisico toegepaste basisvalutabenadering	Verdeling curvatuurrisicocomponenten voor wisselkoersrisico naar scalair	Indiening SBM-validatieportefeuilles	Ruimte voor vrije tekst
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

C 120.04 – DRC. Marktwaarden en bruto JTD-bedragen per instrument/portefeuille

Portefeuille

Geheel getal

Nummer instrument	Risicoklasse	Subklasse 1	Subklasse 2	Debiteur	Kredietkwaliteitscategorie	Wanbetalingsrisicogewicht	Rangorde	Looptijd	Inningspercentage	Richting	Attachment point (%)	Detachment point (%)	Resultaten rapportagevaluta				Resultaten EBA-portefeuillevaluta		
													Notional	P&L + Adjustment	Bruto JTD-bedrag	Valuta	Notional	P&L + Adjustment	Bruto JTD-bedrag
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 SAMENSTELLING PER PORTEFEUILLE

Portefeuille

Geheel getal

Risicoklasse	Subklasse 1	Subklasse 2	Eigenvermogensvereisten (resultaten rapportagevaluta)	Rapportagevaluta	Eigenvermogensvereisten (resultaten EBA-portefeuillevaluta)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 120.06 – ASA. OFR

Portefeuillenummer	Resultaten rapportagevaluta			Resultaten EBA-portefeuillevaluta		
	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070”

ANNEX IV

„BIJLAGE X

SBM-validatieportefeuilles

Naam blad	Beschrijving
Instrumenten	Instrumenten (gevoeligheden en curvatuurrisicoposities) voor SBM-validatiedoeleinden
Portefeuilles	SBM-validatieportefeuilles gedefinieerd als combinaties van in deze bijlage gedefinieerde instrumenten”

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
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	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
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	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
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	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
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	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
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	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
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	ISSUER A			100,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	ISSUER AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	ISSUER AC			– 50,00
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	ISSUER AE			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	ISSUER AF			375,00
S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	ISSUER B			50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	ISSUER F			450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	ISSUER J			– 200,00
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	ISSUER K			– 825,00
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	ISSUER M			– 700,00
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	INDEX N			850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	INDEX O			150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	ISSUER Y			700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	ISSUER A			– 500,00
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	ISSUER AA			– 850,00
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	ISSUER AD			300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	ISSUER AE			– 450,00
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	ISSUER AF			– 725,00
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	ISSUER B			– 500,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	ISSUER F			250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	ISSUER J			– 900,00
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	ISSUER K			– 975,00
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	INDEX N			– 1 250,00
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	INDEX O			100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	ISSUER X			– 200,00
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	ISSUER Z			– 800,00
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	ISSUER A			100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	ISSUER AA			– 300,00
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	ISSUER AB			– 400,00
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	ISSUER AE			– 850,00
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	ISSUER AF			525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	ISSUER B			500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	ISSUER F			600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	ISSUER J			150,00
S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	ISSUER K			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	INDEX N			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	INDEX O			– 200,00

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

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	INDEX Q			– 800,00
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	ISSUER A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	ISSUER AA			– 400,00
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	ISSUER AE			– 250,00
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	ISSUER AF			– 1 150,00
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	ISSUER B			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	ISSUER F			– 750,00
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	ISSUER J			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	ISSUER K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	INDEX N			– 800,00
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	INDEX O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	ISSUER A			– 100,00
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	ISSUER A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	ISSUER AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	ISSUER AE			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	ISSUER AF			– 300,00
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	ISSUER B			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	ISSUER C			– 500,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	ISSUER D			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	ISSUER E			– 800,00
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	ISSUER F			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	ISSUER G			– 400,00
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	ISSUER H			– 50,00
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	ISSUER I			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	ISSUER J			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	ISSUER K			– 300,00
S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	ISSUER L			1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	INDEX N			750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	INDEX O			– 500,00
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	INDEX P			40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	ISSUER A			16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	ISSUER A			– 35 000,00
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	ISSUER B			20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	ISSUER C			66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	ISSUER D			1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	ISSUER E			1 100,00

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

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	ISSUER F			25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	ISSUER G			8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	ISSUER H			22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	ISSUER I			– 12 300,00
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	ISSUER J			– 450,00
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	ISSUER K			– 143,00
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	ISSUER L			– 143,00
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	ISSUER M			– 100,00
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	ISSUER N			– 100,00
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	ISSUER O			– 19 600,00
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	INDEX Q			1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	INDEX R			– 40 000,00
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	INDEX S			– 1 950,00
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	INDEX S			280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	INDEX T			3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	ISSUER U			– 57,00
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	ISSUER V			– 100,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	ISSUER A			50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	ISSUER AA			79 000,00
S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	ISSUER AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	ISSUER AC			– 10 000,00
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	ISSUER B			– 39 000,00
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	ISSUER F			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	ISSUER G			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	ISSUER K			– 14 250,00
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	ISSUER L			– 150 000,00
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	ISSUER M			– 85 000,00
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	ISSUER N			– 72 000,00
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	ISSUER P			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	INDEX Q			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	INDEX R			– 40 000,00
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	INDEX T			– 125 000,00
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	ISSUER X			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	ISSUER Y			4 800,00

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

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

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

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

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	ISSUER T			– 7 400,00
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	ISSUER U			– 11 040,00
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	ISSUER V			38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	ISSUER W			57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	ISSUER Y			13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	ISSUER Z			27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	ISSUER A			100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	ISSUER B			50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	ISSUER C			150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	ISSUER HA			– 750,00
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	ISSUER A			– 500,00
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	ISSUER AB			325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	ISSUER B			– 500,00
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	ISSUER C			100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	INDEX V			500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	ISSUER A			100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	ISSUER B			500,00

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

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	ISSUER C			– 200,00
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	ISSUER A			400,00
S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	ISSUER B			200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	ISSUER C			400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	ISSUER A			– 100,00
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	ISSUER A			700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	ISSUER B			900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	ISSUER C			– 500,00
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	ISSUER D			700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	ISSUER E			– 800,00
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	ISSUER F			700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	ISSUER G			– 400,00
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	ISSUER H			– 50,00
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	ISSUER I			300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	ISSUER J			50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	ISSUER K			– 300,00
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	ISSUER L			1 000,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	ISSUER M			– 350,00
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	ISSUER N			950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	ISSUER O			– 900,00
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	ISSUER P			200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	ISSUER Q			400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	ISSUER R			– 300,00
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEX S			850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	INDEX T			– 650,00
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEX U			– 350,00
S_CND_hb2#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	9	ISSUER HB			– 17 000,00
S_CND_t1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	3	ISSUER T			– 6 000,00
S_CND_y1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	20	INDEX Y			9 000,00
S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	ISSUER AC			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	ISSUER B			– 17 000,00
S_CND_w1#	CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT	10	ISSUER W		CQS 1	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	1	ISSUER A			– 10 000,00
S_CND_s1#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	3	ISSUER S			– 6 000,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	INDEX X			– 18 500,00
S_CND_a1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	ISSUER A			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	ISSUER A			– 30 000,00
S_CND_b1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	ISSUER B			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	3	ISSUER C			– 6 000,00
S_CND_d1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	4	ISSUER D			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	5	ISSUER E			– 4 000,00
S_CND_f1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	6	ISSUER F			– 8 000,00
S_CND_g1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	7	ISSUER G			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	8	ISSUER H			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	9	ISSUER HA			– 23 000,00
S_CND_i1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	10	ISSUER I		CQS 2	– 5 000,00
S_CND_j1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	11	ISSUER J			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	12	ISSUER K			7 000,00
S_CND_l1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	13	ISSUER L			– 9 000,00
S_CND_m1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	14	ISSUER M			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	15	ISSUER N			– 20 000,00

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

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

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

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	ISSUER K			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	ISSUER L			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	ISSUER M			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	ISSUER N			– 23 437,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	ISSUER O			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	ISSUER P			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	ISSUER Q			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	ISSUER R			– 17 504,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	ISSUER S			– 250,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	ISSUER T			– 3 500,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	ISSUER U			– 1 540,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	ISSUER V			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	ISSUER W			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	ISSUER X			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	ISSUER Y			– 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	ISSUER Z			– 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	COAL			– 300,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	URANIUM			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	COAL			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	URANIUM			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	COAL			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	URANIUM			– 250,00
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	COAL			– 200,00
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	URANIUM			– 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	COPPER			– 200,00
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	LIQUEFIED NATURAL GAS			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	SILVER			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	CORN			– 1 000,00
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	WHEY			– 125,00
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	RUBBER			– 50,00
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	POTASH			– 1 800,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	COAL			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	COAL			– 350,00
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	URANIUM			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	STEEL			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	NATURAL GAS			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	GOLD			– 200,00
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	SOYBEANS			– 750,00
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	FISH			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	COCOA			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	FLAT GLASS			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	CORN	OKLAHOMA		– 10 000,00
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FWD ELECTRICITY NE	TEXAS		– 4 500,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		– 68 750,00
S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	SILVER	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	WHEY	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	LIQUEFIED NATURAL GAS	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	RUBBER	NEWCASTLE		– 500,00
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	COPPER	OKLAHOMA		– 2 000,00
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	POTASH	NEWCASTLE		– 18 000,00
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	URANIUM	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	COAL	NEWCASTLE		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	COAL	NEWCASTLE		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	COAL	NEWCASTLE		– 3 500,00
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	COAL	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	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	SPOT ELECTRICITY SE	LONDON		– 3 000,00
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	STEEL	LE HAVRE		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	NATURAL GAS	LE HAVRE		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	GOLD	UK1		– 2 000,00
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	SOYBEANS	LE HAVRE		– 7 500,00
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	FISH	LONDON		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	COCOA	LONDON		3 500,00
S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	FLAT GLASS	LONDON		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	COAL			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	COAL			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	URANIUM			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	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CMC_i1#	CM_CU	5	STEEL			– 5 850,00
S_CMC_j1#	CM_CU	5	COPPER			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	NATURAL GAS			– 6 147,50
S_CMC_l1#	CM_CU	6	LIQUEFIED NATURAL GAS			– 6 147,50
S_CMC_m1#	CM_CU	7	GOLD			– 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	SILVER			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	SOYBEANS			– 14 535,00
S_CMC_p1#	CM_CU	8	CORN			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	FISH			– 19 900,00
S_CMC_r1#	CM_CU	9	WHEY			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	COCOA			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	RUBBER			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	FLAT GLASS			– 13 790,00
S_CMC_v1#	CM_CU	11	POTASH			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	MILK			– 6 300,00
S_CMC_y1#	CM_CU	1	URANIUM			– 65 864,00
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CMC_a1#	CM_CD	1	COAL			– 18 260,00
S_CMC_a2#	CM_CD	1	COAL			– 37 630,00
S_CMC_b1#	CM_CD	1	URANIUM			– 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	STEEL			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	COPPER			– 10 219,80
S_CMC_k1#	CM_CD	6	NATURAL GAS			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	LIQUEFIED NATURAL GAS			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	GOLD			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	SILVER			– 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	SOYBEANS			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	CORN			– 14 735,00

Instrument	Identificator risicofactor	Subklasse	Aanvullende identificator	Aanvullende identificator 2	Kredietkwaliteitscategorie	Risicogevoeligheid
S_CMC_q1#	CM_CD	9	FISH			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	WHEY			– 3 012,00
S_CMC_s1#	CM_CD	10	COCOA			– 1 415,00
S_CMC_t1#	CM_CD	10	RUBBER			– 7 817,20
S_CMC_u1#	CM_CD	11	FLAT GLASS			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	POTASH			– 21 300,00
S_CMC_x1#	CM_CD	9	MILK			– 4 700,00
S_CMC_y1#	CM_CD	1	URANIUM			– 66 344,00
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 22 856,00

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

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
			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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#

Portefeuille	Risicoklasse	Component	Instrumenten
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#”