Europeiska unionens
officiella tidning

SV
L-serien

2025/379

12.3.2025

# KOMMISSIONENS GENOMFÖRANDEFÖRORDNING (EU) 2025/379

**av den 26 februari 2025**

**om ändring av de tekniska genomförandestandarderna i kommissionens genomförandeförordning (EU) 2016/2070 vad gäller referensportföljer, rapporteringsmallar och rapporteringsinstruktioner som ska tillämpas i unionen för den rapportering som avses i artikel 78.2 i Europaparlamentets och rådets direktiv 2013/36/EU**

**(Text av betydelse för EES)**

EUROPEISKA KOMMISSIONEN HAR ANTAGIT DETTA BESLUT

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av Europaparlamentets och rådets direktiv 2013/36/EU av den 26 juni 2013 om behörighet att utöva verksamhet i kreditinstitut och om tillsyn av kreditinstitut, om ändring av direktiv 2002/87/EG och om upphävande av direktiv 2006/48/EG och 2006/49/EG ([1]), särskilt artikel 78.8 tredje stycket, och

av följande skäl:

(1) Enligt artikel 78.1 i direktiv 2013/36/EU ska institut som tillåts använda interna metoder med lämpliga intervaller och minst en gång om året tillhandahålla de behöriga myndigheterna resultaten av beräkningarna av sina riskvägda exponeringsbelopp eller kapitalbaskrav enligt deras interna metoder för exponeringar eller positioner som ingår i referensportföljerna, så att den behöriga myndigheten kan bedöma de interna metodernas kvalitet (riktmärkning). Enligt artikel 78.3 andra stycket i det direktivet ska Europeiska bankmyndigheten (EBA) ta fram en rapport för att bistå de behöriga myndigheterna vid bedömningen av de interna metodernas kvalitet på grundval av resultaten av riktmärkningen. Rapporteringskraven för riktmärkningen anges i kommissionens genomförandeförordning (EU) 2016/2070 ([2]), som har ändrats flera gånger. För att återspegla ändringarna i fokus i de behöriga myndigheternas bedömningar och i EBA:s rapporter, och med hänsyn till ändringar i lagstiftningen på området marknadsrisk, är det nödvändigt att på nytt uppdatera referensportföljerna samt de rapporteringskrav som fastställs i den genomförandeförordningen.

(2) För riktmärkningen av kreditrisken bör instruktionerna ändras så att det specificeras att rapporteringen av riskparametrarna sannolikhet för fallissemang (PD) och förlust vid fallissemang (LGD), med avseende på komponenterna försiktighetsmarginal (MoC), lagstadgade tillägg och nedgång (DWT), som kan vara en källa till variationer i modellerna, är en skyldighet. Dessutom bör det specificeras att instituten är skyldiga att rapportera den modellidentifierare som tilldelats av den behöriga myndigheten, för att underlätta tilldelningen av de data som rapporteras.

(3) Genom kommissionens delegerade förordning (EU) 2024/2795 ([3]) senarelades tillämpningsdatumet för de nya kapitalbaskraven för marknadsrisk. Mallarna för den befintliga internmodellmetoden ersätts därför inte i denna riktmärkning. Samtidigt bör mallarna för validering av schablonmetoden utvidgas till att omfatta ytterligare portföljer jämfört med 2024, då endast ränteinstrument omfattades. Syftet är att säkerställa lämplig tillsyn och ett smidigt genomförande av den nya schablonmetoden, vilken används för beräkning av kapitalgolvet.

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

([2]) Kommissionens genomförandeförordning (EU) 2016/2070 av den 14 september 2016 om fastställande av tekniska tillsynsstandarder för mallar, definitioner och it-lösningar som instituten ska använda vid rapportering till Europeiska bankmyndigheten och behöriga myndigheter i enlighet med artikel 78.2 i Europaparlamentets och rådets direktiv 2013/36/EU (EUT L 328, 2.12.2016, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) Kommissionens delegerade förordning (EU) 2024/2795 av den 24 juli 2024 om ändring av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 vad gäller den dag då kapitalbaskraven för marknadsrisk börjar tillämpas (EUT L, 2024/2795, 31.10.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) Genomförandeförordning (EU) 2016/2070 bör därför ändras i enlighet med detta.

(5) Denna förordning utgår från det förslag till tekniska standarder för genomförande som EBA har lämnat till kommissionen.

(6) EBA har genomfört öppna offentliga samråd om det förslag till tekniska genomförandestandarder som den här förordningen grundas på, analyserat potentiella kostnader och fördelar samt begärt råd från den bankintressentgrupp som inrättats i enlighet med artikel 37 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1093/2010 ([4]).

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

*Artikel 1*

Genomförandeförordning (EU) 2016/2070 ska ändras på följande sätt:

1. Bilaga IV ska ersättas med texten i bilaga I till den här förordningen.
2. Bilaga V ska ersättas med texten i bilaga II till den här förordningen.
3. Bilaga VI ska ersättas med texten i bilaga III till den här förordningen.
4. Bilaga VII ska ersättas med texten i bilaga IV till den här förordningen.
5. Bilaga X ska ersättas med texten i bilaga V till den här förordningen.

*Artikel 2*

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater.

Utfärdad i Bryssel den 26 februari 2025.

*På kommissionens vägnar*
Ursula VON DER LEYEN
*Ordförande*

([4]) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1093/2010 av den 24 november 2010 om inrättande av en europeisk tillsynsmyndighet (Europeiska bankmyndigheten), om ändring av beslut nr 716/2009/EG och om upphävande av kommissionens beslut 2009/78/EG (EUT L 331, 15.12.2010, s. 12, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

*BILAGA I*

*”BILAGA IV*

**REFERENSPORTFÖLJER FÖR TILLSYNSÄNDAMÅL – RESULTAT**

**DEL I: ALLMÄNNA ANVISNINGAR**

**DEL II: MALLRELATERADE ANVISNINGAR**

C 101 – Närmare uppgifter om exponeringar i lågfallissemangsportföljer per motpart

C 102 – Närmare uppgifter om exponeringar i lågfallissemangsportföljer

C 103 – Närmare uppgifter om exponeringar i högfallissemangsportföljer

C 105.01 – Definition av interna modeller

C 105.02 – Mappning av interna modeller till portföljer

C 105.03 – Mappning av interna modeller till länder

**DEL I: ALLMÄNNA ANVISNINGAR**

1. Information ska lämnas endast för de motparter och portföljer där en faktisk exponering föreligger på referensdagen i form av antingen ursprunglig exponering eller exponering efter kreditriskreducering. Information om motparter och portföljer för vilka det inte finns någon exponering på referensdagen ska inte lämnas in.

2. Information ska endast lämnas för de exponeringar för vilka den behöriga myndigheten har godkänt en intern modell för RWA-beräkning. I mall C 101 ska motpartskoder som slutar med ”STDA” inte rapporteras. För de återstående motpartskoderna i mall C 101 i bilaga I och för de referensportföljer som avses i mallarna C 102 och C 103 ska exponeringar enligt schablonmetoden och exponeringar för vilka respektive behörig myndighet har tillåtit tillfällig eller permanent partiell användning av schablonmetoden undantas.

3. Rutor med icke tillämplig/illa definierad information ska antingen lämnas tomma, eller ska ”NULL” fyllas i. Detta gäller även exponeing vid fallisemang (EAD)-viktade kvantiteter eller parametrar som inte kan beräknas. På samma sätt kan datafält vars rapportering inte är obligatorisk lämnas tomma eller lämnas in som ”NULL”. Nollvärden ska endast rapporteras om avsikten är att rapportera kvantiteten eller parametern noll. Ingen av beteckningarna ”tomt” eller ”NULL” ska användas för att rapportera kvantiteter eller parametrar som är noll.

4. Penningbelopp ska rapporteras på samma sätt som de rapporteras för beräkning av kapitalbaskrav vid ett visst referensdatum i enlighet med kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 ([1]).

([1]) Kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 av den 17 december 2020 om tekniska genomförandestandarder för tillämpningen av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 vad gäller instituts tillsynsrapportering och om upphävande av genomförandeförordning (EU) nr 680/2014 (EUT L 97, 19.3.2021, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

**DEL II: MALLRELATERADE ANVISNINGAR**

**C 101 – Närmare uppgifter om exponeringar i lågfallissemangsportföljer per motpart**

Exponeringar mot specialutlåning ska exkluderas.

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Motpartskod | Kolumn 0010 i mall C 101 i bilaga I | Motpartskoden i kolumn 0010 i mall C101 i bilaga I som anger den motpart som ingår i urvalet av lågfallissemangsportföljen (LDP) ska rapporteras. Denna kod ska vara en radidentifierare och ska vara unik för varje rad i mallen. |
| 0020 | Exponeringsklass | Punkt 76 i bilaga II till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Varje motpart ska hänföras till någon av följande exponeringsklasser:<br>a) Nationella regeringar eller centralbanker.<br>b) Institut.<br>c) Företag – små och medelstora företag.<br>d) Företag – specialutlåning.<br>e) Företag - övriga.<br>f) Hushåll – säkrade genom små och medelstora företags fasta egendom.<br>g) Hushåll – säkrade genom större företags fasta egendom.<br>h) Hushåll – kvalificerade revolverande exponeringar.<br>i) Hushåll – övriga små och medelstora företag.<br>j) Hushåll – övriga större företag.<br>k) Ej tillämpligt.<br>”Ej tillämpligt” används när ingen av klasserna i listan är tillämplig, vilket är fallet när exponeringarna mot en motpart är klassificerade i flera exponeringsklasser och ingen av dem är uppenbart dominerande. |
| 0040 | Riskklass | | Rangordningen för den interna riskklass som tilldelats motparten inom institutets tillämpliga interna riskklasskala ska rapporteras. Den ska följa en numerisk ordning 1, 2, 3 osv., från lägsta till högsta risk, exklusive fallissemang med ett PD-värde på 100 %.<br>Om en institution använder en kontinuerlig klassningsskala i enlighet med artikel 169.3 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 ([2]), ska riskklassen som rapporteras i kolumn 0005 i mall C 08.02 i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2021/451 användas.<br>Om exponeringar mot en motpart har hänförts till flera riskklasser i enlighet med artikel 172.1 e i eller iii i förordning (EU) nr 575/2013, ska riskklass noll (0) rapporteras. |

([2]) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 av den 26 juni 2013 om tillsynskrav för kreditinstitut och värdepappersföretag och om ändring av förordning (EU) nr 648/2012 (EUT L 176, 27.6.2013, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0050 | Datum för den senaste riskklassificeringen av motparten | | Datum för den senaste riskklassificeringen av motparten. |
| 0060 | Probability of Default (PD) | Mall C 08.01, kolumn 0010, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Motpartens PD-värde ska rapporteras. PD-värdet ska vara det PD-värde som används i RWA-beräkningen, exklusive effekten av de åtgärder i enlighet med artikel 458 i förordning (EU) nr 575/2013. PD-värdet för den interna riskklass som institutet placerar den hypotetiska transaktionen i. PD-värdet ska anges som ett värde mellan 0 och 1. |
| 0070 | Fallissemangsstatus | | Motpartens fallisemangsstatus ska rapporteras. Den ska vara en av följande i enlighet med artikel 178 i förordning (EU) nr 575/2013:<br>a) Fallerat.<br>b) Icke-fallerat. |
| 0080 | Ursprunglig exponering före tillämpning av konverteringsfaktorer | Mall C 08.01, kolumn 0020, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Ursprunglig exponering före eventuella värdejusteringar, avsättningar, effekter av kreditriskreducering eller konverteringsfaktorer ska rapporteras. |
| 0090 | Exponering efter kreditriskreducering med substitutionseffekter och före tillämpning av konverteringsfaktorer | Mall C 08.01, kolumn 0090, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Det värde som en kreditkonverteringsfaktor tillämpas på för att beräkna EAD (kolumn 0110) ska rapporteras.. Hänsyn ska tas till kreditriskreducering som får substitutionseffekter på exponeringen. |
| 0100 | Kreditkonverteringsfaktor | Artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013 | Det vägda genomsnittliga värdet av konverteringsfaktorerna ska rapporteras. De vikter som används ska vara de värden på vilka konverteringsfaktorerna tillämpas för att beräkna EAD.<br>För motparter med endast faciliteter för de poster som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013 ska det vägda genomsnittet för kreditkonverteringsafaktorerna baseras på alla faciliteter.<br>För motparter vilkas faciliteter inte omfattas av de poster som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013,ska kreditkonverteringsafaktorn antingen lämnas tom, eller ska ”NULL” fyllas i. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | För motparter med faciliteter som motsvarar de poster som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013 och faciliteter som inte omfattas av de poster som anges i artikel 166.8 i den förordningen, ska det rapporterade vägda genomsnittet för kreditkonverteringsafaktorn endast baseras på de faciliteter som motsvarar poster som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013. I synnerhet ska inte faciliteter som motsvarar poster som anges i artikel 166.10 i den förordningen tas med i beräkningen.<br><br>Om institutet tillämpar egna skattningar av konverteringsfaktorer för de poster som anges i artikel 166.8 i dförordning (EU) nr 575/2013, ska de konverteringsfaktorerna användas för att beräkna det vägda genomsnittet av konverteringsfaktorerna. Om institutet inte tillämpar egna skattningar av konverteringsfaktorer för de poster som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013 ska de föreskrivna konverteringsfaktorerna som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013 användas.<br><br>Kreditkonverteringsfaktorn ska anges som ett värde mellan 0 och 1. |
| 0110 | Förväntad årlig skada | Mall C 08.01, kolumn 0110, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Exponeringsvärdet ska rapporteras. |
| 0120 | Säkerhetens värde | Kolumnerna 0150–0210 i mall C 08.01 i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Säkerhetens marknadsvärde ska rapporteras. |
| 0130 | Hypotetisk LGD-värde för senior icke-säkerställd exponering utan negativ klausul | Artikel 161 i förordning (EU) nr 575/2013 | Hypotetiska egna skattningar av LGD-värde som institutet skulle tillämpa på exponeringarna på motparten ska rapporteras i enlighet med följande:<br>a) Exponeringens omfattning är densamma som för LGD-värden som rapporteras i kolumn 0150.<br>b) Exponeringarna är prioriterade och saknar säkerhet.<br>c) Inga negativa klausuler finns.<br><br>En negativ klausul är en klausul som fastställer att låntagaren eller emittenten inte kommer att ställa några av sina tillgångar som pant för en annan part. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0140 | Hypotetisk LGD-värde för senior icke-säkerställd exponering med negativ klausul | Artikel 161 i förordning (EU) nr 575/2013 | Hypotetiska egna skattningar av LGD-värde som institutet skulle tillämpa på exponeringarna på motparten ska rapporteras i enlighet med följande:<br>a) Exponeringens omfattning är densamma som för LGD-värden som rapporteras i kolumn 0150.<br>b) Exponeringarna är prioriterade och saknar säkerhet.<br>c) En negativ klausul finns.<br>En negativ klausul är en klausul som fastställer att låntagaren eller emittenten inte kommer att ställa några av sina tillgångar som pant för en annan part. |
| 0150 | LGD-värde. | Kolumnerna 0230 och 0240 i mall C 08.01 i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Det EAD-viktade genomsnittet av LGD-värdena för exponeringarna mot motparten ska rapporteras.<br>LGD-värdena ska vara de som används för RWA-beräkning. Om institutet har fått tillstånd från sin behöriga myndighet att använda egna skattningar av LGD-värdena, ska dessa baseras på institutets egna skattningar, annars ska de baseras på lagstadgade LGD-värden med beaktande av tillämplig riskreducering.<br>LGD-värdena för stora reglerade enheter i den finansiella sektorn och oreglerade enheter i den finansiella sektorn ska inkluderas.<br>Effekten av åtgärder som inför i enlighet med artikel 458 i förordning (EU) nr 575/2013 ska uteslutas.<br>LGD-värdet ska anges som ett värde mellan 0 och 1. |
| 0160 | Löptid | Mall C 08.01, kolumn 0250, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | EAD-viktad löptid för exponeringar mot motparten ska rapporteras. Löptiden ska anges i antal dagar. |
| 0170 | Riskvägda tillgångar | Mall C 08.01, kolumn 0260, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Riskvägda tillgångar efter stödfaktorer (stödfaktorer för små och medelstora företag och infrastruktur) ska rapporteras. De riskvägda tillgångarna ska inte omfatta effekten av potentiella åtgärder enligt artikel 458 i förordning (EU) nr 575/2013. |

**C 102 – Närmare uppgifter om exponeringar i lågfallissemangsportföljer**

För portföljer definierade i bilaga I med en annan status vad gäller ställda säkerheter än ”Ej tillämpligt” kan följande information utelämnas, om den godkända modellen inte är anpassad för olika LGD-beräkningar för säkerställda och icke-säkerställda delar av en exponering: LGD-värde (kolumn 0130), LGD-värde utan tillsynsåtgärder (kolumn 0131), LGD-värde utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder (kolumn 0132), LGD-värde utan försiktighetsmarginal, tillsynsåtgärder och nedgångskomponent (kolumn 0133), förväntat förlustbelopp (kolumn 0150) och riskvägda tillgångar (kolumn 0170).

För portföljer vars metod definieras som ”Indelningskriterier för specialutlåning” ska följande information utelämnas: PD-värde (kolumn 0060), PD-värde utan tillsynsåtgärder (kolumn 0061), PD-värde utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder (kolumn 0062), LGD-värde (kolumn 0130), LGD-värde utan tillsynsåtgärder (kolumn 0131), LGD-värde utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder (kolumn 0132), LGD-värde utan försiktighetsmarginal, tillsynsåtgärder och nedgångskomponent (kolumn 0133).

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Portfölj-id | Kolumn 0010 i mall C 102 i bilaga I | Det portfölj-id i kolumn 0010 i mall C.102 i bilaga I som definierar portföljen ska rapporteras. Detta ID ska vara en radidentifierare och ska vara unik för varje rad i mallen.<br>Tilldelningen av exponeringar mot portfölj-ID är inte exklusiv: Exponeringar eller delar av exponeringar ska rapporteras i varje tillämpligt portfölj-ID. |
| 0040 | Antal gäldenärer | | Antal gäldenärer ska rapporteras.<br>Den ska baseras på gäldenärer som har ett strikt positivt värde som rapporteras antingen i kolumn 0080 eller 0090. Om en fullständig substitution tillämpas på grund av en kreditriskreduceringsmetod, ska den ursprungliga gäldenären läggas till i ”Antal motparter” i sin ursprungliga portfölj, och garantigivaren ska läggas till garantiportföljens ”Antal gäldenärer”. |
| 0060 | Probability of Default (PD) | Mall C 08.01, kolumn 0010, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | PD-värdet ska vara det PD-värde som används i RWA-beräkningen, exklusive effekten av de potentiella åtgärder som införts i enlighet med artikel 458 i förordning (EU) nr 575/2013. För portföljer motsvarande en individuell riskklass eller riskklasspool ska instituten rapportera det PD-värde som åsatts gäldenärsklass eller gäldenärsklasspool. När det gäller portföljer motsvarande aggregerade gäldenärer i olika riskklasser eller riskklasspooler ska instituten ange det EAD-viktade genomsnittet av de PD-värden som åsatts de exponeringar som ingår i aggregeringen. PD-värdet för den interna riskklass som institutet placerar den hypotetiska transaktionen i. PD-värdet ska anges som ett värde mellan 0 och 1. |
| 0061 | PD-värde utan tillsynsåtgärder | | PD-värdet utan tillsynsåtgärder ska var det PD-värde som grundar sig på bestämmelserna i artiklarna 179 och 180 i förordning (EU) nr 575/2013 som inbegriper den försiktighetsmarginal som tillämpas av institutet men som utesluter åtgärder (multiplikatorer, addender, golv eller liknande åtgärder som direkt höjer PD-värdet) som har införts av de behöriga myndigheterna.<br>När det gäller portföljer motsvarande en individuell riskklass eller riskklasspool, ska instituten rapportera PD-värdet för den klass som inbegriper försiktighetsmarginalen men som är rensad för tillsynsåtgärderna. När det gäller portföljer motsvarande aggregerade gäldenärer i olika riskklasser eller riskklasspooler, ska instituten rapportera det EAD-viktade genomsnittet av PD-värdena av respektive exponeringar där försiktighetsmarginalen ingår men som är rensad för tillsynsåtgärderna.<br>PD-värdet utan tillsynsåtgärder ska anges som ett värde mellan 0 och 1.<br>Om institutet inte kan isolera de försiktiga justeringarna, ska punkt 3 i del 1 tillämpas. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0062 | PD-värdet utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder | | PD-värdet utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder ska vara det PD-värde som inbegriper varken den försiktighetsmarginal som tillämpas av institutet i enlighet med artikel 179.1 f och artikel 180.1 e i förordning (EU) nr 575/2013 eller effekten av åtgärder som vidtagits av the behöriga myndigheterna (multiplikatorer, addender, golv eller liknande åtgärder som direkt höjer PD-värdet).<br><br>När det gäller portföljer motsvarande en individuell riskklass eller riskklasspool, ska instituten rapportera PD-värdet för den klass som är rensad för försiktighetsmarginalen och rensad för tillsynsåtgärderna. När det gäller portföljer motsvarande aggregerade gäldenärer i olika riskklasser eller riskklasspooler ska instituten rapportera det EAD-viktade genomsnittet av PD-värdena av respektive exponeringar som är rensade för försiktighetsmarginalerna och rensade för tillsynsåtgärderna.<br><br>PD-värdet utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder ska anges som ett värde mellan 0 och 1.<br>Om institutet inte kan isolera de försiktiga justeringarna, ska punkt 3 i del 1 tillämpas. |
| 0080 | Ursprunglig exponering före tillämpning av konverteringsfaktorer | Mall C 08.01, kolumn 0020, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Ursprunglig exponering före eventuella värdejusteringar, avsättningar, effekter av kreditriskreducering eller konverteringsfaktorer ska rapporteras. |
| 0090 | Exponering efter kreditriskreducering med substitutionseffekter och före tillämpning av konverteringsfaktorer | Mall C 08.01, kolumn 0090, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Det värde som en kreditkonverteringsfaktor tillämpas på för att beräkna EAD (kolumn 0110) ska rapporteras. Hänsyn ska tas till kreditriskreducering som får substitutionseffekter på exponeringen. |
| 0100 | Kreditkonverteringsfaktor | Artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013 | Det vägda genomsnittliga värdet av konverteringsfaktorerna ska rapporteras. De vikter som används ska vara de värden på vilka konverteringsfaktorerna tillämpas för att beräkna EAD.<br><br>För portföljer som omfattar faciliteter som uteslutande motsvarar poster som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013 ska det vägda genomsnittet för kreditkonverteringsfaktorerna baseras på alla faciliteter.<br><br>För portföljer för vilka inga av de omfattade faciliteterna omfattas av de poster som anges i artikel 166 i förordning (EU) nr 575/2013,ska kreditkonverteringsafaktorn antingen lämnas tom, eller ska ”NULL” fyllas i.<br><br>För portföljer som omfattar faciliteter som motsvarar de poster som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013 och faciliteter som inte omfattas av de poster som anges i artikel 166.8 i den förordningen, ska det rapporterade vägda genomsnittet för kreditkonverteringsafaktorn endast baseras på de faciliteter som motsvarar poster som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013. I synnerhet ska inte faciliteter som motsvarar poster som anges i artikel 166.10 i den förordningen tas med i |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | beräkningen.<br>Om institutet tillämpar egna skattningar av konverteringsfaktorer för de poster som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013, ska dessa konverteringsfaktorer användas för att beräkna det vägda genomsnittet av konverteringsfaktorerna. Om institutet inte tillämpar egna skattningar av konverteringsfaktorer för de poster som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013 ska de föreskrivna konverteringsfaktorerna som anges i artikel 166.8 i förordning (EU) nr 575/2013 användas.<br>Kreditkonverteringsfaktorn ska anges som ett värde mellan 0 och 1. |
| 0110 | Förväntad årlig skada | Mall C 08.01, kolumn 0110, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Exponeringsvärdet ska rapporteras. |
| 0120 | Säkerhetens värde | Kolumnerna 0150–0210 i mall C 08.01 i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Säkerhetens marknadsvärde ska rapporteras. |
| 0130 | LGD-värde. | Kolumnerna 230 och 240 i mall C 08.01 i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Det EAD-viktade genomsnittet av LGD-värdena för exponeringarna i respektive portfölj ska rapporteras.<br>LGD-värdena ska vara de som används för RWA-beräkning. Om institutet har fått tillstånd från sin behöriga myndighet att använda egna skattningar av LGD-värdena, ska dessa baseras på institutets egna skattningar, annars ska de baseras på lagstadgade LGD-värden med beaktande av tillämplig riskreducering.<br>Exponeringar och de respektive LGD-värdena för stora reglerade enheter i den finansiella sektorn och oreglerade enheter i den finansiella sektorn ska inkluderas.<br>Effekten av åtgärder som inför i enlighet med artikel 458 i förordning (EU) nr 575/2013 ska uteslutas.<br>LGD-värdet ska anges som ett värde mellan 0 och 1. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0131 | LGD-värde utan tillsynsåtgärder | | LGD-värdet utan tillsynsåtgärder ska var det LGD-värde som grundar sig på bestämmelserna i artiklarna 179 och 181 i förordning (EU) nr 575/2013 som inbegriper den försiktighetsmarginal som tillämpas av institutet men som utesluter åtgärder (multiplikatorer, addender, golv eller liknande åtgärder som direkt höjer LGD-värdet) som har införts av de behöriga myndigheterna.<br><br>När det gäller portföljer motsvarande en individuell riskklass eller riskklasspool, ska instituten rapportera LGD-värdet för den klass som inbegriper försiktighetsmarginalen men som är rensad för tillsynsåtgärderna.<br><br>När det gäller portföljer motsvarande aggregerade gäldenärer i olika riskklasser eller riskklasspooler, ska instituten rapportera det EAD-viktade genomsnittet av LGD-värdena av respektive exponeringar där försiktighetsmarginalen ingår men som är rensad för tillsynsåtgärderna.<br><br>LGD-värdet utan tillsynsåtgärder ska anges som ett värde mellan 0 och 1.<br><br>Om institutet inte kan isolera de försiktiga justeringarna, ska punkt 3 i del 1 tillämpas. |
| 0132 | LGD-värdet utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder | | LGD-värdet utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder ska vara det LGD-värde som inbegriper varken den försiktighetsmarginal som tillämpas av institutet i enlighet med artikel 179.1 f och artikel 181 i förordning (EU) nr 575/2013 eller effekten av åtgärder som vidtagits av the behöriga myndigheterna (multiplikatorer, addender, golv eller liknande åtgärder som direkt höjer LGD-värdet).<br><br>När det gäller portföljer motsvarande en individuell riskklass eller riskklasspool, ska instituten rapportera LGD-värdet för den klass som är rensad för försiktighetsmarginalen och rensad för tillsynsåtgärderna. När det gäller portföljer motsvarande aggregerade gäldenärer i olika riskklasser eller riskklasspooler ska instituten rapportera det EAD-viktade genomsnittet av LGD-värdena av respektive exponeringar som är rensade för försiktighetsmarginalerna och rensade för tillsynsåtgärderna.<br><br>LGD-värdet utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder ska anges som ett värde mellan 0 och 1.<br><br>Om institutet inte kan isolera de försiktiga justeringarna, ska punkt 3 i del 1 tillämpas. |
| 0133 | LGD-värdet utan försiktighetsmarginal, tillsynsåtgärder och nedgångskomponent | | LGD-värdet utan försiktighetsmarginal, tillsynsåtgärder och nedgångskomponent ska vara det LGD-värde som inbegriper varken den försiktighetsmarginal som tillämpas av institutet i enlighet med artikel 179.1 f och artikel 181 i förordning (EU) nr 575/2013 eller effekten av åtgärder som vidtagits av the behöriga myndigheterna (multiplikatorer, addender, golv eller liknande åtgärder som direkt höjer LGD-värdet) eller inbegriper den nedgångskomponent som krävs enligt artikel 181.1 b i den förordningen.<br><br>När det gäller portföljer motsvarande en individuell riskklass eller riskklasspool, ska instituten rapportera LGD-värdet för den klass som är rensad för försiktighetsmarginalen och rensad för tillsynsåtgärderna samt rensad för nedgångskomponenten. När det gäller portföljer motsvarande aggregerade gäldenärer i olika riskklasser eller riskklasspooler, ska instituten rapportera det EAD-viktade genomsnittet av LGD-värdena av respektive exponeringar som är rensade för försiktighetsmarginalen och rensade för tillsynsåtgärder samt rensade för nedgångskomponenten. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | LGD-värdet utan försiktighetsmarginal, tillsynsåtgärder och nedgångskomponent ska anges som ett värde mellan 0 och 1.<br>Om institutet inte kan isolera de försiktiga justeringarna, ska punkt 3 i del 1 tillämpas. |
| 0140 | Löptid | Mall C 08.01, kolumn 0250, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Den EAD-viktade löptiden ska rapporteras. Löptiden ska anges i antal dagar.<br>Denna uppgift ska inte rapporteras för de exponeringar vars löptid inte ingår i beräkningen av riskvägda exponeringsbelopp. I synnerhet ska löptiden inte rapporteras för portföljer som utgör exponeringar inom exponeringsklassen ”Hushåll”. |
| 0150 | Förväntad förlust | Mall C 08.01, kolumn 0280, i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Det förväntade förlustbeloppet ska rapporteras. |
| 0160 | Avsättningar fallerade exponeringar | Kolumnerna 0050, 0055 och 0060 i mall C 09.02 i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Avsättningar för fallerade exponeringar ska rapporteras. Dessa ska omfatta alla allmänna och specifika kreditriskjusteringar avseende exponeringar i fallisemang enligt artikel 110 i förordning (EU) nr 575/2013. (Engångs) kreditriskjusteringar som ett institut tillämpar i samband med ändringar i metoden för definition av fallissemang ska rapporteras i enlighet med vad som registrerats i institutets databas. |
| 0170 | Riskvägda tillgångar | Mall C 08.01, kolumn 0260, i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Riskvägda tillgångar efter stödfaktorer (stödfaktorer för små och medelstora företag och infrastruktur) ska rapporteras. De riskvägda tillgångarna ska inte omfatta effekten av potentiella åtgärder enligt artikel 458 i förordning (EU) nr 575/2013. |
| 0180 | Riskvägda tillgångar enl. schablonmetoden | Del tre avdelning II kapitel 2 i förordning (EU) nr 575/2013 | RWA enligt schablonmetoden är det hypotetiska RWA-värde som beräknas genom att på exponeringarna tillämpa schablonmetoden för kreditrisk i stället för internmetoden. |

**C 103 – Närmare uppgifter om exponeringar i högfallissemangsportföljer**

För de portföljer som anges i bilaga I med en annan status vad gäller ställda säkerheter än ”Ej tillämpligt” kan följande information utelämnas, om den godkända modellen inte är anpassad för olika LGD-beräkningar för säkerställda och icke-säkerställda delar av en exponering: LGD-värde (kolumn 0130), LGD-värde utan tillsynsåtgärder (kolumn 0131), LGD-värde utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder (kolumn 0132), LGD-värde utan försiktighetsmarginal, tillsynsåtgärder och nedgångskomponent (kolumn 0133), förväntat förlustbelopp (kolumn 0150), riskvägda tillgångar (kolumn 0170), förluströnta det senaste året (kolumn 0210) och förluströnta de senaste 5 åren (kolumn 0220).

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Portfölj-id | | Det portfölj-id i kolumn 0010 i tabell C 103 i bilaga I som definierar portföljen ska rapporteras. Detta ID ska vara en radidentifierare och ska vara unik för varje rad i mallen.<br>Tilldelningen av exponeringar mot portfölj-ID är inte exklusiv: Exponeringar eller delar av exponeringar ska rapporteras i varje tillämpligt portfölj-ID. |
| 0040 | Antal gäldenärer | | Instruktionerna för kolumn 0040 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0060 | Probability of Default (PD) | | Instruktionerna för kolumn 0060 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0061 | PD-värde utan tillsynsåtgärder | | Instruktionerna för kolumn 0061 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0062 | PD-värdet utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder | | Instruktionerna för kolumn 0062 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0080 | Ursprunglig exponering före tillämpning av konverteringsfaktorer | | Instruktionerna för kolumn 0080 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0090 | Exponering efter kreditriskreducering med substitutionseffekter och före tillämpning av konverteringsfaktorer | | Instruktionerna för kolumn 0090 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0100 | Kreditkonverteringsfaktor | | Instruktionerna för kolumn 0100 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0110 | Förväntad årlig skada | | Instruktionerna för kolumn 0110 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0120 | Säkerhetens värde | | Instruktionerna för kolumn 0120 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0130 | LGD-värde. | | Instruktionerna för kolumn 0130 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0131 | LGD-värde utan tillsynsåtgärder | | Instruktionerna för kolumn 0131 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0132 | LGD-värdet utan försiktighetsmarginal och tillsynsåtgärder | | Instruktionerna för kolumn 0132 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0133 | LGD-värdet utan försiktighetsmarginal, tillsynsåtgärder och nedgångskomponent | | Instruktionerna för kolumn 0133 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0140 | Löptid | | Instruktionerna för kolumn 0140 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0150 | Förväntad förlust | | Instruktionerna för kolumn 0150 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0160 | Avsättningar fallerade exponeringar | | Instruktionerna för kolumn 0160 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0170 | Riskvägda tillgångar | | Instruktionerna för kolumn 0170 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0180 | Riskvägda tillgångar enl. schablonmetoden | | Instruktionerna för kolumn 0180 i mall C 102 i bilaga I ska tillämpas. |
| 0190 | Fallissemangsandel förra året | | Fallissemangsandelen för det senaste år för vilket uppgifter finns tillgängliga. I detta syfte ska fallissemangsandelen definieras som kvoten mellan följande värden:<br>a) summan av de exponeringar (ursprunglig exponering, kolumn 0080, mätt på referensdagen minus ett år) som var icke-fallerade exakt ett år före referensdagen och som fallerade mellan referensdagen minus ett år och referensdagen,<br>b) summan av de exponeringar (ursprunglig exponering, kolumn 0080, mätt på referensdagen minus ett år) som var icke-fallerade på referensdagen minus ett år.<br>Nya exponeringar som genererades under året före referensdagen ska inte ingå. Exponeringar som fallerade och som tillfrisknade under året före referensdagen ska ingå i både täljaren och nämnaren. Flera fallissemang hos samma gäldenär ska bara anges en gång. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | Dessa uppgifter ska rapporteras endast för portföljidentifieringskoder som gäller icke-fallerade exponeringar, och de ska uttryckas som ett värde mellan 0 och 1.<br><br>Fallissemangs- och fallissemangsdatum ska användas såsom de registrerades vid genomförandet av den tillämpliga försäkran om fallissemang vid tidpunkten för händelsen. Detta innebär att ett institut ska anse att ett fallissemang har inträffat med avseende på den försäkran om fallissemang som tillämpades av institutet vid tidpunkten för registreringen av händelsen. Ändringar i försäkran om överensstämmelse ska endast övervägas framåtblickande från och med dagen för genomförandet, medan retroaktiv tillämpning av ändringar av försäkran om överensstämmelse efter den fallissemangshändelse som övervägs (bakåtsimulering) inte ska användas. |
| 0200 | Fallissemangsandel de senaste 5 åren | | Det viktade genomsnittet av fallissemangsandelarna under de senaste 5 åren före referensdagen ska rapporteras. Definitionen av den fallissemangsandel som avses i kolumn 0190 ska gälla. De vikter som ska användas är de icke-fallerade exponeringar som används vid beräkning av andelen fallissemang i enlighet med kolumn 0190.<br><br>Om institutet uppmanas att beräkna en fallissemangsandel för de senaste fem åren före referensdagen enligt artikel 180.1 h, eller artikel 180.2 e, i förordning (EU) nr 575/2013, ska institutet ta fram ett närmevärde genom att använda sin längsta historiska dataserie upp till fem år före referensdagen och lägga fram dokumentation för sin beräkning för sin behöriga myndighet.<br><br>Dessa uppgifter ska rapporteras endast för portföljidentifieringskoder som gäller ”icke-fallerade” exponeringar, och de ska uttryckas som ett värde mellan 0 och 1.<br><br>Fallissemangs- och fallissemangsdatum ska användas såsom de registrerades vid genomförandet av den tillämpliga försäkran om fallissemang vid tidpunkten för händelsen. Detta innebär att ett institut ska anse att ett fallissemang har inträffat med avseende på den försäkran om fallissemang som tillämpades av institutet vid tidpunkten för registreringen av händelsen. Ändringar i försäkran om överensstämmelse ska endast övervägas framåtblickande från och med dagen för genomförandet, medan retroaktiv tillämpning av ändringar av försäkran om överensstämmelse efter den fallissemangshändelse som övervägs (bakåtsimulering) inte ska användas. |
| 0210 | Förlustandel förra året | | Förlustandelen för det senaste året ska endast rapporteras för portföljidentifieringskoder som gäller ”icke-fallerade” och ”fallerade” exponeringar.<br><br>För icke-fallerade portföljer ska förlustandelen vara summan av kreditriskjusteringar och nedskrivningar som tillämpas inom året före referensdagen på exponeringar som inte fallerat exakt ett år före referensdagen och på exponeringar som fallerade under året före referensdagen, dividerad med summan av EAD, mätt exakt ett år före referensdagen, av de exponeringar som inte fallerat exakt ett år före referensdagen och som fallerade under året före referensdagen. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | Täljaren i förlustandelen ska omfatta alla kreditriskjusteringar och avskrivningar som avser exponeringar som fallerat under det år som föregår referensdagen, inklusive de kreditriskjusteringar som tillämpats före fallissemangsdagen.<br><br>Nya exponeringar som genererades under året före referensdagen ska inte ingå. Exponeringar som fallerade och som tillfrisknade igen under året före referensdagen ska tas med i nämnaren i förlustandelen, och kreditriskjusteringar och nedskrivningar för de exponeringarna ska beaktas i täljaren i förlustandelen. Flera fallissemang hos samma gäldenär ska bara anges en gång.<br><br>För fallerade portföljer ska förlustandelen avse exponeringar som fallerat exakt ett år före referensdatumet. Den ska vara summan av<br>a) kreditriskjusteringar av dessa exponeringar ett år före referensdatumet, och<br>b) kreditriskjusteringar och avskrivningar som tillämpas under det år som föregår referensdatumet,<br><br>dividerat med summan av EAD-värdet, mätt exakt ett år före referensdagen för de berörda exponeringarna.<br><br>Nya fallissemang under året före referensdagen får inte ingå. Exponeringar som fallerade och som tillfrisknade igen under året före referensdagen ska tas med i nämnaren i förlustandelen, och kreditriskjusteringar och nedskrivningar för de exponeringarna ska beaktas i täljaren av förlustandelen. Flera fallissemang hos samma gäldenär ska bara anges en gång.<br><br>Förlustandelen ska anges som ett värde mellan 0 och 1.<br><br>Fallissemangs- och fallissemangsdatum ska användas såsom de registrerades vid genomförandet av den tillämpliga försäkran om fallissemang vid tidpunkten för händelsen. Detta innebär att ett institut ska anse att ett fallissemang har inträffat med avseende på den försäkran om fallissemang som tillämpades av institutet vid tidpunkten för registreringen av händelsen. Ändringar i försäkran om överensstämmelse ska endast övervägas framåtblickande från och med dagen för genomförandet, medan retroaktiv tillämpning av ändringar av försäkran om överensstämmelse efter den fallissemangshändelse som övervägs (bakåtsimulering) inte ska användas. |
| 0220 | Förlustandel de senaste fem åren | | Det EAD-viktade genomsnittet av förlustandelarna under de senaste fem åren före referensdagen ska endast rapporteras för portföljidentifieringskoder som gäller ”icke-fallerade” och ”fallerade” exponeringar. Definitionen av förlustandelen i kolumn 0210 ska gälla.<br><br>Förlustandelen under de senaste fem åren ska baseras på de senaste fem årens årliga förlustnivåer, om dessa årliga förlustnivåer definieras i analogi med definitionen av förlustgraden i kolumn 0210, och de årliga förlustnivåerna ska i synnerhet inte omfatta ytterligare förändringar av kreditriskjusteringar och nedskrivningar som har inträffat efter observationsperioden (kalenderåret) för varje årlig förlustnivå.<br><br>Om institutet uppmanas att använda data för de senaste fem åren före referensdagen enligt artikel 181.2 sista stycket i förordning (EU) nr 575/2013, ska det ta fram ett närmevärde genom att använda sin längsta historiska dataserie upp till fem år före referensdagen och lägga fram dokumentation för sin beräkning för sin behöriga myndighet.<br><br>Förlustandelen ska anges som ett värde mellan 0 och 1.<br><br>Fallissemangs- och fallissemangsdatum ska användas såsom de registrerades vid genomförandet av den tillämpliga försäkran om fallissemang vid tidpunkten för händelsen. Detta innebär att ett institut ska anse att ett fallissemang har inträffat med avseende på den försäkran om fallissemang som tillämpades av institutet vid tidpunkten för registreringen av händelsen. Ändringar i försäkran om överensstämmelse ska endast övervägas framåtblickande från och med dagen för genomförandet, medan retroaktiv tillämpning av ändringar av försäkran om överensstämmelse efter den fallissemangshändelse som övervägs (bakåtsimulering) inte ska användas. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0250 | Riskvägda tillgångar- (RWA-) | | Instituten ska beräkna och rapportera RWA- för de portföljer som avses i mall 103 i bilaga I med följande portfölj-id:n:<br><br>CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL<br>SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br><br>RWA- ska vara de hypotetiska riskvägda tillgångarna, efter tillämpning av stödfaktorerna, som är resultatet av tillämpningen av PD--värden i stället för institutets PD-värden, för varje exponering. De återstående parametrar som behövs för beräkningen ska inte vara föremål för ändringar.<br><br>PD- ska grundas på en beräkning göras separat för varje gäldenärsklass. De gäldenärsklasser som rapporteras i kolumn 0005 i mall C 08.02 i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 ska användas (se bilaga II till den förordningen, mall C 0010, kolumn 08.02 och mall C 08.02, för anvisningar).<br><br>För varje gäldenärsklass ska $p^-$ vara det lägsta positiva värde som satisfierar ekvationen<br><br>$$p^- + \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^- \bullet (1-p^-)}{n}} \geq DR_{1y}$$<br><br>where $DR_{1y} > 0$, och $p^- = 0$ där $DR_{1y} = 0$.<br>Där<br><br>$\Phi^{-1}$ = den normala (kumulativa) standardfördelningens inverterade funktion,<br><br>q = en konfidensnivå på 90 %,<br><br>$DR_{1y}$ = den antalsvägda fallissemangsandelen för året före referensdagen, dvs. antalet ej fallerande gäldenärer hänförda till den aktuella gäldenärsklassen exakt ett år före referensdagen och som fallerade under det senaste året, dividerat med antalet ej fallerande gäldenärer hänförda till den aktuella gäldenärsklassen exakt ett år före referensdagen,<br><br>n = antalet ej fallerande gäldenärer hänförda till den aktuella gäldenärsklassen exakt ett år före referensdagen.<br><br>För varje gäldenär ska PD- vara lika med $p^-$, där $p^-$ ska beräknas i enlighet med ovanstående formel för den gäldenärsklass som tilldelats gäldenären. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0260 | Riskvägda tillgångar+ (RWA +) | | Instituten ska beräkna och rapportera RWA+ för de portföljer som avses i tabell C 103 i bilaga I med följande portfölj-id:<br><br>CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL<br>SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br><br>RWA+ ska vara de hypotetiska riskvägda tillgångarna, efter tillämpning av stödfaktorerna, som är resultatet av tillämpningen av PD+-värden i stället för institutets PD-värden, för varje exponering. De återstående parametrar som behövs för beräkningen ska inte vara föremål för ändringar.<br><br>PD+ ska grundas på en beräkning som görs separat för varje gäldenärsklass. De gäldenärsklasser som rapporteras i kolumn 0005 i mall C 08.02 i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 ska användas (se bilaga II till den förordningen, mall C 0010, kolumn 08.02 och mall C 08.02 för anvisningar).<br><br>För varje gäldenärsklass ska $p^+$ vara det största positiva värde som satisfierar ekvation<br><br>$$p^+ - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^+ \bullet (1-p^+)}{n}} \leq DR_{1y}$$<br><br>I denna ekvation är<br><br>$\Phi^{-1}$ = den normala (kumulativa) standardfördelningens inverterade funktion,<br><br>q = en konfidensnivå på 90 %,<br><br>$DR_{1y}$ = den antalsvägda fallissemangsandelen för året före referensdagen, dvs. antalet ej fallerande gäldenärer hänförda till den aktuella gäldenärsklassen exakt ett år före referensdagen och som fallerade under det senaste året, dividerat med antalet ej fallerande gäldenärer hänförda till den aktuella gäldenärsklassen exakt ett år före referensdagen,<br><br>n = antalet ej fallerande gäldenärer hänförda till den aktuella gäldenärsklassen exakt ett år före referensdagen.<br><br>För varje gäldenär ska PD+ vara lika med $p^+$, där $p^+$ ska beräknas i enlighet med ovanstående formel för den gäldenärsklass som tilldelats gäldenären. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0270 | Riskvägda tillgångar– (RWA–) | | Instituten ska beräkna och rapportera RWA– för de portföljer som avses i tabell C 103 i bilaga I med följande portfölj-id:<br>CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL<br>SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>RWA– ska vara de hypotetiska riskvägda tillgångarna, efter tillämpning av stödfaktorerna, som är resultatet av tillämpningen av PD-–värden i stället för institutets PD-värden, för varje exponering. De återstående parametrar som behövs för beräkningen ska inte vara föremål för ändringar.<br>PD-- ska grundas på en beräkning som görs separat för varje gäldenärsklass. De gäldenärsklasser som rapporteras i kolumn 0005 i mall C 08.02 i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 ska användas (se bilaga II till den förordningen, mall C 0010, kolumn 08.02 och mall C 08.02, för anvisningar).<br>För varje gäldenärsklass ska $p^{--}$ vara det lägsta positiva värde som satisfierar ekvationen<br>$$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{--} \cdot (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$<br>where $DR_{5y} > 0$, och $p^{-} = 0$ där $DR_{5y} = 0$<br>Där<br>$\Phi^{-1}$ = den normala (kumulativa) standardfördelningens inverterade funktion,<br>q = en konfidensnivå på 90 %,<br>$DR_{5y}$ = de senaste 5 årens fallissemangsandel för riskklassen, beräknad som ett aritmetiskt medelvärde av fem ettåriga antalsvägda fallissemangsandelar,<br>n = antalet ej fallerande gäldenärer hänförda till den aktuella gäldenärsklassen exakt ett år före referensdagen.<br>För varje gäldenär ska PD++ vara lika med $p^{--}$, där $p^{--}$ ska beräknas i enlighet med ovanstående formel för den gäldenärsklass som tilldelats gäldenären. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0280 | Riskvägda tillgångar++ (RWA++) | | Instituten ska beräkna och rapportera RWA++ för de portföljer som avses i tabell C 103 i bilaga I med följande portfölj-id:n:<br><br>CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL<br>SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL<br>RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br>RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL<br><br>RWA++ ska vara de hypotetiska riskvägda tillgångarna, efter tillämpning av stödfaktorerna, som är resultatet av tillämpningen av PD++-värden i stället för institutets PD-värden, för varje exponering. De återstående parametrar som behövs för beräkningen ska inte vara föremål för ändringar.<br><br>PD++ ska grundas på en beräkning som görs separat för varje motpartsriskklass. De gäldenärsklasser som rapporteras i kolumn 0005 i mall C 08.02 i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2021/451 ska användas (se bilaga II till den förordningen, mall C 0010, kolumn 08.02 och mall C 08.02 för anvisningar).<br><br>För varje gäldenärsklass ska $p^{++}$ vara det största positiva värde som satisfierar ekvation<br><br>$$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{++} \cdot (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$<br><br>där<br><br>$\Phi^{-1}$ = den normala (kumulativa) standardfördelningens inverterade funktion,<br><br>q = en konfidensnivå på 90 %,<br><br>$DR_{5y}$ = de senaste 5 årens fallissemangsandel för riskklassen, beräknad som ett aritmetiskt medelvärde av fem ettåriga antalsvägda fallissemangsandelar,<br><br>n = antalet ej fallerande gäldenärer hänförda till den aktuella gäldenärsklassen exakt ett år före referensdagen.<br><br>För varje gäldenär ska PD++ vara lika med $p^{++}$, där $p^{++}$ ska beräknas i enlighet med ovanstående formel för den gäldenärsklass som tilldelats gäldenären. |

**C 105.01 – Definition av interna modeller**

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Internmodell-ID | | Institutet ska rapportera den internmodell-ID som sätts av den behöriga myndigheten. Om den inte finns att tillgå, ska institutet rapportera den internmodell-ID som det själv satt. Det modell-ID som används internt ska på ett unikt sätt hänvisa till en intern modell som godkänts av den behöriga myndigheten och som används för beräkning av riskvägda tillgångar. Detta ID ska vara en radidentifierare och ska vara unik för varje rad i mallen. |
| 0020 | Modellens namn | | Det interna modellnamn som tilldelats den interna modellen av det rapporterande institutet ska rapporteras. |
| 0030 | Riskparameter enligt internmetoden | | Den riskparameter enligt internmetoden som ska rapporteras ska vara någon av följande:<br>a) PD-<br>b) LGD-värde.<br>c) Konverteringsfaktor.<br>För en intern modell för Företag – specialutlåning enligt artikel 153.5 i förordning (EU) nr 575/2013 (”Indelningskriterier för specialutlåning”) ska fältet lämnas tomt eller ”NULL” införas. |
| 0040 | Förväntad årlig skada | Mall C 08.01, kolumn 0110, i bilaga I till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Det samlade exponeringsvärdet av de exponeringar som omfattas av riskklassificeringsmodellen ska rapporteras. |
| 0050 | EAD-vägd genomsnittlig fallissemangsandel för kalibrering | | EAD-vägt genomsnitt av årliga fallissemangsandelar som används i kalibreringen av PD-modeller ska rapporteras. Denna information ska endast anges för PD- modeller. De data som används vid kalibreringen av modellparametrarna ska användas. Om det inte finns några interna data och kalibreringen baseras på externa uppgifter, ska de externa uppgifterna rapporteras. |
| 0060 | Antalsvägd genomsnittlig fallissemangsandel för kalibrering | | Det antalsvägda aritmetiska medelvärdet av de årliga antalsvägda fallissemangsandelar som används i kalibreringen av PD-modellerna ska rapporteras. Denna information ska endast anges för PD- modeller.<br>De data som används vid kalibreringen av modellparametrarna ska användas. Om det inte finns några interna data och kalibreringen baseras på externa uppgifter, ska de externa uppgifterna rapporteras. |
| 0070 | Långsiktigt PD-värde | | Den centrala tendens som institutet använder i kalibreringen av modeller som integrerar eventuella konservativa justeringar av det antalsvägda genomsnitt av årliga fallissemangsandelar som används i kalibreringen av PD-modellerna ska rapporteras. Denna information ska endast anges för PD- modeller. |
| 0080 | Tillfriskningsgrad fallerade fordringar | | Tillfriskningsgraden för fallerade tillgångar ska vara den procentuella andel av fallerade utestående fordringar som återgår till ”icke-fallerad” status under en 12-månadersperiod.<br>Ett institut som inte beräknar tillfriskningsgrader för en viss modell ska ta fram ett närmevärde i enlighet med denna definition. Institutet ska rapportera att det använder ett närmevärde till den behöriga myndigheten. Denna information ska endast anges för LGD-modeller. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0090 | Återvinningsgrad utmätta tillgångar som inte tillfrisknat från fallissemang | | Det antalsvägda genomsnittet av återvinningsgraden för tillgångar som inte tillfrisknat från fallissemang i den tidsserie som institutet använder för att kalibrera LGD-modeller för icke-fallerade fordringar ska rapporteras.<br>De data som används vid kalibreringen av modellparametrarna ska användas. Om det inte finns några interna data och kalibreringen baseras på externa uppgifter, ska de externa uppgifterna rapporteras. Ett institut som inte har en särskild återvinningsgrad för exponeringar som inte tillfrisknat från fallissemang på grund av ett ofullständigt återvinningsförfarande ska beräkna ett närmevärde med beaktande av observerade återvinningar och skattningar av återvinningar för ej avslutade omförhandlingar. Institutet ska rapportera att det använder ett närmevärde till den behöriga myndigheten. Denna information ska endast anges för LGD-modeller. |
| 0100 | Längd på återvinningsperioden utmätta tillgångar som inte tillfrisknat från fallissemang | | Antalsvägd genomsnittlig längd på återvinningsperioden (från det att fallissemangsstatus inträder till dess att återvinningsförfarandena är avslutade) avseende exponeringar som inte tillfrisknat från fallissemang i den tidsserie som institutet använder för att kalibrera LGD-modeller för icke-fallerade fordringar ska rapporteras. Den antalsvägda genomsnittliga längden ska uttryckas i antal dagar.<br>De data som används vid kalibreringen av modellparametrarna ska användas. Om det inte finns några interna data och kalibreringen baseras på externa uppgifter, ska de externa uppgifterna rapporteras.<br>Ett institut som inte har en särskild längd på återvinningsperioden för exponeringar som inte tillfrisknat från fallissemang på grund av ett ofullständigt återvinningsförfarande ska beräkna ett närmevärde med utgångspunkt i denna definition. Institutet ska rapportera att det använder ett närmevärde till den behöriga myndigheten. Denna information ska endast anges för LGD-modeller. |
| 0110 | Gemensamt beslut | Artikel 20.2 a i förordning (EU) nr 575/2013 | Institutet ska rapportera om det finns ett gemensamt beslut om tillsynskrav mellan den samordnande behöriga myndigheten och den behöriga myndigheten i värdstaten gällande tillstånd att använda internmetoden för beräkning av tillsynskraven för exponeringar hos institutens dotterinstitut i de referensportföljer som rapporteras. |
| 0120 | Samordnande tillsynsmyndighet | Artikel 20 i förordning (EU) nr 575/2013 | ISO-koden för ursprungslandet för den behöriga myndighet som är ansvarig för den gruppbaserade tillsynen över det institut som använder internmetoden. |
| 0130 | Riskvägda tillgångar | Mall C 08.01, kolumn 0260, i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Det samlade riskvägda tillgångarna efter stödjande faktorer (små och medelstora företag och infrastrukturstödjande faktorer) i de exponeringar som omfattas av riskklassificeringsmodellen ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0140 | Addend enligt RWA | | Tilläggen till riskvägda tillgångar ska vara en underposition (”varav”) till riskvägda tillgångar (kolumn 0130 i mall C 105.01) och omfatta följande:<br>a) Riskvägda tillgångar som läggs till de riskvägda tillgångar som följer av tillämpningen av modellens riskparametrar på grund av ytterligare interna försiktighetsåtgärder som tillämpas direkt på riskvägda tillgångar, om sådana finns,<br>b) riskvägda tillgångar som läggs till de riskvägda tillgångar som följer av tillämpningen av modellens riskparametrar på grund av tillsynsåtgärder som tillämpas direkt på riskvägda tillgångar.<br><br>Beloppen enligt leden a och b ska inte omfatta åtgärder som redan återspeglas i PD (kolumn 0060 i mall C102 och kolumn 0060 i mall C103), kreditkonverteringsfaktorer (kolumn 0100 i mall C102 och kolumn 0100 i mall C103) eller LGD (kolumn 0130 i mallar C102 och kolumn 0130 i mall C103), men ska begränsas till åtgärder som tillämpas direkt på riskvägda tillgångar och, i förekommande fall, utöver försiktighetsmarginalerna och tillsynsåtgärderna (multiplikatorer, tillägg, golv eller liknande åtgärder) som ökar riskparametrarna.<br><br>Tilläggen till de riskvägda tillgångarna ska inte omfatta effekten av potentiella åtgärder enligt artikel 458 i förordning (EU) nr 575/2013.<br><br>Om institutet inte kan isolera de försiktiga justeringarna, ska punkt 3 i del 1 tillämpas. |

**C 105.02 – Mappning av interna modeller till portföljer**

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Portfölj-id | kolumn 0010 i mall C102 och kolumn 0010 i mall C103 | Det portfölj-id som unikt identifierar portföljen i enlighet med bilaga I, mallarna C102 och C103, ska rapporteras.<br><br>Kolumnerna 0010 och 0020 är en sammansatt radidentifierare, och måste tillsammans vara unika för varje rad i denna mall. |
| 0020 | Internmodell-ID | Mall C 105.01, kolumn 0010 | Det internmodell-ID som sätts av det rapporterande institutet ska rapporteras.<br>Kolumnerna 0010 och 0020 är en sammansatt radidentifierare, och måste tillsammans vara unika för varje rad i mall C105.02. |
| 0030 | Förväntad årlig skada | Mall C 08.01, kolumn 0110, i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Det aggregerade exponeringsvärdet av de exponeringar som ingår i den portfölj som definieras i kolumn 0010 och inom tillämpningsområdet för den riskklassificeringsmodell som definieras i kolumn 0020 ska rapporteras. När alla exponeringar för en viss portfölj behandlas med en viss modell, ska exponeringsvärdet vara detsamma som det belopp som rapporterats för samma portfölj i kolumn 0110 i mall C102 eller kolumn 0110 i mall C103, beroende på vad som är tillämpligt. |
| 0040 | Riskvägda tillgångar | Mall C 08.01, kolumn 0260, i bilaga I till genomförandeförordning (EU) 2021/451 | Det aggregerade exponeringsvärdet efter stödfaktorer av de exponeringar som ingår i den portfölj som definieras i kolumn 0010 och inom tillämpningsområdet för den riskklassificeringsmodell som definieras i kolumn 0020 ska rapporteras. När alla exponeringar för en viss portfölj behandlas med en viss modell, ska RWA vara detsamma som det belopp som rapporterats för samma portfölj i kolumn 0170 i mall C102 eller kolumn 0170 i mall C103, beroende på vad som är tillämpligt. |

**C 105.03 – Mappning av interna modeller till länder**

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0005 | Rad-ID | | Denna kod ska vara en radidentifierare och ska vara unik för varje rad i mallen. Den ska följa en numerisk ordning 1, 2, 3 osv. |
| 0010 | Internmodell-ID | Mall C105.01, kolumn 0010 | Det internmodell-ID som sätts av det rapporterande institutet ska rapporteras. Om ett internmodell-ID är associerat till flera länder, ska varje kombination av ”Internmodell-ID” och ”Institutets lokaliseringsort” rapporteras på separata rader. Kolumnerna 0010 och 0020 är en sammansatt radidentifierare, och kombinationen av dem måste vara unik för varje rad i tabellen. |
| 0020 | Institutets lokaliseringsort | Artikel 20 i förordning (EU) nr 575/2013 | ISO-landskoden för varje dotterbolags rättsliga hemvist i vilket de exponeringar enligt internmetoden som rapporteras för varje referensportfölj bokförs ska rapporteras oavsett om det finns ett tillstånd från värdtillsynsmyndigheten att använda internmetoden.” |

*BILAGA II*

*”BILAGA V*

**MARKNADSRISK – REFERENSINSTRUMENT OCH REFERENSPORTFÖLJER**

Avsnitt 1: Anvisningar

Avsnitt 2: Instrument

Avsnitt 3: Individuella portföljer – Ett enda instrument

Avsnitt 4: Individuella portföljer – Flera instrument

Avsnitt 5: Aggregerade portföljer

Avsnitt 6: Ytterligare specifikationer för instrument

Avsnitt 7: SBM-valideringsportföljer

**Avsnitt 1: Anvisningar**

a) I denna bilaga gäller följande definitioner:

i) *bokningsdag*: dag och tidpunkt då instituten bokför transaktionerna för riktmärkningen.

ii) *initial marknadsvärdering* (*IMV*): det aktuella marknadsvärdet för det instrument som avses i avsnitt 2 i denna bilaga på IMV-referensdatumet och tidpunkten.

iii) *IMV-referensdatum*: den dag och tidpunkt som institut ska hänvisa till vid fastställande av IMV för transaktionerna i referensportföljen.

iv) *IMV-rapporteringsöverföringsdatum*: den dag då institut senast ska ha inlämnat resultaten av IMV avseende transaktionerna i referensportföljen.

v) *VaR-värde*: Value-at-Risk-värde.

vi) *sVaR-värde*: stressjusterat Value-at-Risk-värde.

vii) *IRC*: Incremental Risk charge, dvs. kapitalkrav för tillkommande fallissemangs- och migrationsrisk.

viii) *KHP*: korrelationshandelsportfölj.

ix) *APR*: alla prisrisker, beräknat i enlighet med artikel 377.2 i förordning (EU) nr 575/2013.

x) *riskmått* (*RM*): VaR-värde, sVaR-värde och, om nödvändigt, IRC och APR för portföljerna på det sätt som anges i avsnitten 3, 4 och 5 i denna bilaga, mellan första RM-referensdagen och sista RM-referensdagen.

xi) första RM-referensdagen: den dag institut ska börja beräkna RM-värdena.

xii) sista RM-referensdagen: den dag instituten ska sluta beräkna RM-värdena.

xiii) RM-överföringsdagen: den dag då instituten senast ska lämna in RM-resultaten för transaktionerna i referensportföljen.

xiv) Nuvärde (PV): det aktuella marknadsvärde för portföljerna som anges i avsnitt 3 i denna bilaga på den sista RM-referensdagen.

xv) ATM: At-the-money med avseende på förhållandet mellan priset på det underliggande och lösenpriset på derivatet.

xvi) OTM: Out-of-the-money med avseende på förhållandet mellan priset på det underliggande och lösenpriset på derivatet.

xvii) ITM: In-the-money med avseende på förhållandet mellan priset på det underliggande och lösenpriset på derivatet.

xviii) 'Lång position' betyder 'köpt' och 'kort position' betyder 'såld'.

xix) CDS: kreditswapp.

xx) När det gäller kreditswappar betyder 'lång' 'köpt skydd' och 'kort' 'sålt skydd'.

xxi) MLN: miljoner.

xxii) OTC: over-the-counter, dvs. handel som inte bedrivs på en reglerad marknad.

xxiii) *ASA*: alternativ schablonmetod i den mening som avses i del tre avdelning IV kapitel 1a avsnitt 1 i förordning (EU) nr 575/2013.

xxiv) *SBM*: känslighetsbaserad metod i den mening som avses i del tre avdelning IV kapitel 1a avsnitt 2 i förordning (EU) nr 575/2013.

xxv) *DRC*: fallissemangsriskkravet i den mening som avses i del tre avdelning IV kapitel 1a avsnitt 5 i förordning (EU) nr 575/2013.

xxvi) *RRAO*: tillägg för kvarstående risk i den mening som avses i del tre avdelning IV kapitel 1a avsnitt 4 i förordning (EU) nr 575/2013.

b) Följande datum ska gälla för ’riktmärkningen’:

i) Bokningsdagen ska vara den 30 januari 2025.

ii) IMV- (och första SBM-) referensdagen ska vara den 6 februari 2025 (kl. 17.30 MET).

iii) IMV- (och första SBM-, och SBM-validerings-) överföringsdagen ska vara den 28 februari 2025.

iv) Första RM-referensdagen ska vara den 2 juni 2025.

v) RM- (och sista ASA-) referensdagen ska vara den 13 juni 2025.

vi) RM- (och sista ASA-) överföringsdagen ska vara den 18 juli 2025.

c) Om inget annat uttryckligen anges i avsnitt 2 i denna bilaga ska alla positioner bokföras på den bokningsdag som avses i led b i i detta avsnitt. Så snart positionerna har bokförts ska portföljerna åldras under den tid riktmärkningen pågår och ska beräknas utifrån antagandet att institutet inte på något sätt aktivt förvaltar portföljen under hela den tid riktmärkningen pågår. Om inget annat uttryckligen anges i specifikationerna för ett visst instrument, ska lösenpriser för optionspositioner fastställas relativt de priser på det underliggande som observeras vid marknadsstängning på bokningsdagen.

d) Värderingen av varje instrument ska senast på IMV-överföringsdagen lämnas till institutets behöriga myndighet för initial marknadsvärdering. Institutet ska senast den dagen lämna in en förklarande anmärkning tillsammans med resultaten i enlighet med led e. IMV ska om möjligt lämnas i enlighet med institutets front office-värdering. Om IMV inte lämnas av institutets front office ska institutet närmare ange datakällan för IMV i den förklarande anmärkningen.

e) Den förklarande anmärkning som institut ska lämna tillsammans med IMV ska omfatta alla följande uppgifter för varje instrument:

i) Vilka riskfaktorer som har använts för att beräkna institutets IMV.

ii) Vilken prissättningsmodell som har använts för att beräkna instrumentets IMV och en beskrivning av denna modell.

iii) Vilka riskfaktorer som ingår i VaR-modellen för instrumentet.

iv) Vilka riskfaktorer som ingår i VaR-modellen och som även används i beräkningen av instrumentets IMV.

v) Närmare uppgifter om VaR-modellen för instrumentet.

vi) Tillgängliga referensdata för instrumentet i institutets eget format.

vii) De aspekter som avses i leden h, i, k, m, n, o, v, w, y, gg och kk i detta avsnitt.

f) Vid tillämpning av led e v ska samtliga följande uppgifter rapporteras:

i) Koncisa beskrivningar av VaR-modellen.

ii) Vilka omvärderingsmetoder som tillämpats.

iii) Vilken funktionella form som används för att modellera avkastning (t.ex. absolut, relativ, andra metoder.

iv) Kvalitativ information om den tidsserie som har använts för att kalibrera VaR-modellen för instrumentet (t.ex. källa, metod för normalisering, intervaller som tillämpats, annan information som instituten bedömer vara relevanta för att förklara de resultat som lämnas in).

g) Den förklarande anmärkning som avses i led d ska uppdateras varje gång ett nytt värde lämnas in för att förklara förändringar jämfört med tidigare inlämnade uppgifter. Den förklarande anmärkningen ska innehålla ett avsnitt med alla inlämnandedatum och skälen till varför nya uppgifter lämnats in.

h) Riskerna i positionerna ska beräknas utan hänsyn till finansieringskostnaderna. Instituten ska i tillämpliga fall använda sig av daglåneräntan för instrumentets valuta som diskonteringsränta. Ett avtal om säkerheter ska anses finnas för de derivatinstrument som avses i avsnitt 2 i denna bilaga. Om detta inte är möjligt ska skälen anges i den förklarande anmärkning som avses i led d.

i) Motpartsrisk och kreditvärderingsjusteringsrisk ska inte beaktas i värderingen av portföljernas risker. Om detta inte är möjligt, ska skälen anges i den förklarande anmärkning som avses i d) i detta avsnitt. Instituten ska rapportera fall där andra typer av värderingsjusteringar inkluderas i IMV och för varje finansiellt instrument redogöra för metoden och effekten i den förklarande anmärkning som avses i led d i detta avsnitt.

j) För transaktioner som innefattar långa positioner i kreditswappar ska direkt avgift antas ha betalats i enlighet med marknadsnormer och -konventioner för att gå in i positionen. Förfallodagen för alla kreditswappar ska antas vara konventionella kvartalsvisa slutdatum.

k) Ytterligare specifikationer som är nödvändiga för att göra de prissättningsberäkningar som krävs för positioner i kreditswappar ska överensstämma med allmänt vedertagna marknadsnormer och -konventioner samt förklaras i den förklarande anmärkning som avses i led d i detta avsnitt.

l) Förfallodagen ska säkerställa att transaktionen ligger närmast den angivna löptiden i enlighet med marknadsnormer och -konventioner.

m) Vad gäller närmare uppgifter om instrument som inte nämns i avsnitt 2 i denna bilaga, ska instituten ange vilka antaganden som har använts, inbegripet dagräkningskonvention och val av omsättningsbara och likvida instrument där detta är tillåtet, samt resultaten, i den förklarande anmärkning som avses i led d i detta avsnitt.

n) Institut som anser att antaganden utöver de som anges i detta avsnitt är relevanta för tolkningen av resultaten, t.ex. tidpunkt för affärsdagens slut, coupon rolls, mappning mot index etc., ska lämna en beskrivning av dessa antaganden i den förklarande anmärkning som avses i led d i detta avsnitt.

o) Den förklarande anmärkning som avses i led d i detta avsnitt ska inkludera förklaringar av risker som inte fångas upp av den modell för instrumenten som avses i avsnitt 2 i denna bilaga.

p) Alla optioner ska behandlas som om de handlas OTC, om inget annat uttryckligen anges.

q) Standardtidkonventioner för OTC-optioner ska följas. Tid till förfall för en option på n månader ska anges i n månader. Om optioner förfaller på en dag som inte är handelsdag ska institut flytta förfallodagen till närmast påföljande bankdag i enlighet med marknadsnormer och -konventioner.

r) Alla OTC-optioner ska behandlas enligt följande:

   i) Som amerikanska, om de avser aktier i bara ett företag eller råvaror.

   ii) Som europeiska, om de avser aktieindex, valutor eller swaptioner.

s) Alla OTC-optioner ska betraktas som ’nakna’, dvs. premien ska inte räknas med i den initiala marknadsvärderingen.

t) När det gäller KHP ska institut som har tillstånd att använda APR-modellen för KHP lämna uppgifter om sina mest relevanta antaganden, marknadsnormer och -konventioner vad gäller de KHP-instrument som avses i avsnitt 2 i denna bilaga, inbegripet de säkringskvoter de har beräknat för att göra KHP-instrumenten CS01-neutrala på bokningsdagen.

u) IMV för varje instrument ska lämnas i EBA-instrumentets valuta, som anges i avsnitt 2 i denna bilaga för det instrumentet.

v) För portföljer som består av ett eller flera instrument som är denominerade i EBA-instruments valutor som skiljer sig från EBA-portföljens valuta ska resultatet konverteras till den rapporterade EBA-portföljens valuta med hjälp av ECB-avistaväxelkursen av det relevanta datumet. Det konverterade resultatet ska förklaras i den förklarande anmärkning som avses i led d i detta avsnitt.

w) När instituten bokför positioner ska de följa lämpliga marknadskonventioner, om inget annat anges i dessa instruktioner i instrumentbeskrivningarna (avsnitt 2 i denna bilaga).

x) Om ett instrument eller det underliggande instrumentet för ett derivat påverkas av en företagshändelse som påverkar riktmärkningen, (t.ex. en förtida inlösen av emittenten, ett fallissemang eller liknande) ska instituten exkludera detta instrument från riktmärkningen tillsammans med eventuella kreditswappar eller optioner som är kopplade till instrumentet.

y) När det gäller en indexserie ska 'on-the-run' avse den mest likvida och handelsbara serien av det indexet som är tillgängligt på marknaden. Instituten ska förklara sitt val av "on-the-run"-serie tillsammans med relaterade resultat i den åtföljande förklarande anmärkning som avses i led d i detta avsnitt.

z) Om inte något annat anges, ska instituten tillämpa EU:s referensvärdesförordning i fråga om räntenivån för att boka de instrument som anges i avsnitt 2 i denna bilaga. Instituten ska i den förklarande anmärkning som avses i led d i detta avsnitt ange den nivå som tillämpas, bortsett från de som anges i avsnitt 2 i denna bilaga.

aa) Riskmått för de portföljer som avses i avsnitten 3, 4 och 5 i denna bilaga tillsammans med nuvärdet (PV) ska beräknas från och med "första RM-referensdagen" till och med "sista RM-referensdagen". FRTB ASA riskmått (SBM, DRC och RRAO) ska beräknas för "sista RM-referensdagen". Instituten ska ha lämnat in resultaten av dessa beräkningar till sin behöriga myndighet senast på RM-överföringsdagen. IMV och SBM ska rapporteras för varje instrument. Riskmått, SBM, DRC, RRAO och nuvärde ska i tillämpliga fall rapporteras för respektive portfölj, både individuellt och aggregerat. SBM, DRC och RRAO ska i tillämpliga fall rapporteras för åtminstone de portföljer för vilka riskmått rapporteras.

bb) För de portföljer som avses i avsnitt 7 ska instituten rapportera SBM-resultat och lämna in dem i överensstämmelse med rapporteringsdatumen för inlämnandet av IMV.

cc) Kreditspreadportföljer ska endast rapporteras av institut som har fått tillstånd att modellera specifik risk för skuldinstrument. För ränteportföljer som inkluderar risk som en del av vissa instrument ska individuella och aggregerade portföljer modelleras av institut som har fått tillstånd att modellera allmän ränterisk samt institut som har fått tillstånd att modellera allmän och specifik ränterisk.

dd) Resultaten för både de individuella och de aggregerade portföljerna ska lämnas in enbart om resultaten för de instrument som ingår i dem också lämnas in.

ee) I avsnitt 2 i denna bilaga (Instrument) ska år T avse 2025 och år T + X avse 2025 + X, där X specificeras i avsnitt 2.

ff) I avsnitt 2 i denna bilaga (Instrument) ska institut fastställa förfallodag i enlighet med följande instruktioner:

i) Om datum anges ska detta specifika datum användas.

ii) Om inget datum anges ska eventuell marknadskonvention användas. Om det till exempel finns en marknadskonvention enligt vilken förfallodagen är den tredje fredagen i månaden ska "juni år T" avse den tredje fredagen i juni år T.

iii) Vid månadens slut, när det står Slutet av, är det månadens sista kalenderdag som avses.

iv) För en fast period efter bokningsdagen, om perioden anges i antal dagar, är det den sista dagen på denna period som avses. Om perioden anges i veckor, månader eller år avses samma dag följande vecka, månad eller år med avseende på bokningsdagen eller, om den sista månaden eller det sista året under perioden är kortare, sista dagen denna månad eller detta år; om "bokningsdag + x-perioden" är en helgdag, ska närmast påföljande vardag väljas.

v) Om inte annat anges ska följande antaganden användas: Dagräkningskonvention: Act/360, helgdagskalender: Target2.

gg) I avsnitt 2 i denna bilaga (Instrument) ska, om inget annat uttryckligen anges, följande krav gälla för alla kreditswappar:

i) Kupongfrekvens: kvartalsvis.

ii) Kupong(punkter): 100.

iii) Dagräkning: ACT/360;

iv) ISDA-definitioner år: 2014.

v) Omstruktureringsklausul: modifierad-modifierad omstrukturering (MMR).

vi) Förfallodag: december år T+4.

vii) Typ av skuld: Högre prioritering.

viii) Löptid: 5 år.

ix) Effektivt datum samma som bokningsdag.

x) Den diskonteringskurva och återvinningsgrad som används ska anges i den förklarande anmärkning som avses i led d i denna bilaga.

hh) Obligationsinstrumentens IMV ska omfatta upplupen ränta.

ii) Instituten ska lämna informationen om tidpunkt för beräkning av nuvärdet (PV) i den förklarande anmärkning som avses i led d i detta avsnitt. Beräkningen av nuvärdet (PV) ska göras vid bankdagens slut.

jj) Portföljens riskmått ska beräknas i samma valuta som portföljvalutan, utan medräkning av valutarisk, också i förhållande till institutens rapporteringsvaluta. Valutarisken ska beaktas endast när den faktiskt ingår i instrumenten. Om både resultaten uttryckta i rapporteringsvaluta och resultaten uttryckta i portföljens valuta ska rapporteras, ska när det gäller ASA-sifforna resultaten som beräknas i institutets rapporteringsvaluta omräknas i EBA-portföljens valuta genom avistakonvertering med hjälp av den ECB-avistaväxelkurs som gällde vid beräkningen. Omräkningen i EBA-portföljens valuta medför inte en ändring i valutariskfaktorerna.

kk) Om artikel 325q.7 i förordning (EU) nr 575/2013 (metod med en ”basvaluta”) gäller, ska instituten vid SBM-beräkningar och rapportering av SBM-känsligheter beakta de valutariskfaktorer som följer av tillämpningen av basvalutametoden. De rapporterade värdena ska inte uttryckas i en vald basvaluta, utan i institutets rapporteringsvaluta genom avistakonvertering med hjälp av ECB-avistaväxelkursen vid det relevanta datumet.

**Avsnitt 2: Instrument**

Instituten ska lämna IMV i enlighet med instruktionerna i avsnitt 1 i denna bilaga för följande finansiella instrument, för vilka de ska tillhandahålla riskmåtten samt nuvärdet (PV) för de portföljer som anges i avsnitten 3 och 4:

**AKTIER**

101. Lång position i EURO STOXX 50-indexet (Ticker: SX5E) futures.

Teoretiskt värde: motsvarande indexvärdet gånger 1 000 EUR

Börs: Eurex

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

102. Lång position på 10 000 BAYER (Ticker: BAYN GR) aktier.

Börs: Xetra

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Teoretiskt värde: motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Börs: Eurex

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Börs: Euronext

Förfallodag: juni Yår T

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Börs: Eurex

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Börs: Eurex

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: GBP

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

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Börs: Eurex

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Börs: Euronext

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

109. Lång position i köpoption. Underliggande: BAYER (Ticker: BAYN GR) ATM (1 kontrakt = 100 aktier).

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

110. Kort position i köpoption. Underliggande: BAYER (Ticker: BAYN GR) ATM (1 kontrakt = 100 aktier).

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Förfallodag: december år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

111. Lång position i köpoption. Underliggande: PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM, (1 kontrakt = 100 aktier).

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: USD

112. Lång position i säljoption. Underliggande: PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM, (1 kontrakt = 100 aktier).

Teoretiskt värde: motsvarande värde av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: USD

113. Lång position i köpoption. Underliggande: BAYER (Ticker: AV/GR) 10 % OTM (1 kontrakt = 100 aktier).

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Förfallodag: december år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

114. Kort position i köpoption. Underliggande: BAYER (Ticker: AV/GR) 10 % OTM (1 kontrakt = 100 aktier).

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

115. Lång position i köpoption. Underliggande: AVIVA (Ticker: AV/LN) 10 % OTM (1 kontrakt = 100 aktier).

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Förfallodag: december år T

EBA-instrumentets valuta: GBP

116. Lång position i säljoption. Underliggande: AVIVA (Ticker: AV/LN) 10 % OTM (1 kontrakt = 100 aktier).

Teoretiskt värde: Motsvarande värdet av 10 000 andelar i den underliggande tillgången

Förfallodag: december år T

EBA-instrumentets valuta: GBP

117. Kort position i futures NIKKEI 225 (Ticker NKY).

Teoretiskt värde: motsvarande indexvärdet gånger 20 000 JPY

Börs: CME

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: JPY

118. Automatiskt uppsägbar aktieprodukt.

Lång position

Bokföring på ”bokningsdagen”

Teoretiskt belopp (”kapital”): 1 000 000 EUR

Underliggande: EURO STOXX 50-indexet (Ticker: SX5E)

EBA-instrumentets valuta: EUR

Förfallodag: 5 år

Årlig utbetalning och årlig observation (”Bokningsdag + 1 år”, ”Bokningsdag + 2 år”, ”Bokningsdag + 3 år”, ”Bokningsdag + 4 år”, Bokningsdag + 5 år). Utbetalning sker 10 dagar efter referensdagen.

Kupong: 6%

Nivå för automatisk uppsägning (”initialt värde”): slutet av dagen bokningsdagen + 1 månad

Barriärkupongutbetalning 60 % av nivån för automatisk uppsägning

Skyddsbarriär: 55 % av nivån för automatisk uppsägning

— Kapitalet garanteras inte om index ligger under skyddsbarriären (kapital som återbetalas år 5 kommer att vara proportionellt om nivån ligger under skyddsbarriären: t.ex., om SX5E = 40 % av sin ursprungliga nivå, återbetalas 40 % av kapitalet).

— Om SX5E ≥ 60 % (barriärkupong) av det initiala värdet vid slutet av ett år, betalas en kupong på 6 % ut.

— Om SX5E ≥ 100 % av det initiala värdet vid slutet av ett år, sägs produkten upp och utbetalningen blir kupongen plus kapitalbeloppet (100 %).

— Om SX5E < 60 % (barriärkupong) av det initiala värdet vid slutet av ett år, betalas ingen kupong ut.

— Om SX5E < 55 % (skyddsbarriär) av det initiala värdet vid slutet av år 5, betalas kapitalbeloppet endast ut proportionellt. Om SX5E >= 55 % (skyddsbarriär) av det initiala värdet vid slutet av år 5 betalas kapitalbeloppet ut i sin helhet.

119. Lång position i köpoption. Underliggande EURO STOXX 50-indexet (Ticker: SX5E), ATM.

Teoretiskt värde: motsvarande indexvärdet gånger 1 000 EUR

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

120. Lång position i köpoption. Underliggande EURO STOXX 600-indexet (Ticker: SXXP), ATM.

Teoretiskt värde: motsvarande indexvärdet gånger 10 000 EUR

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: EUR

121. Lång position i köpoption. Underliggande VIX (CBOE), ATM.

Teoretiskt värde: motsvarande indexvärdet gånger 100 000 USD

Förfallodag: juni år T

EBA-instrumentets valuta: USD

**IR**

201. 5-årig EUR-ränteswapp – erhåll fast ränta och betala rörlig ränta.

Fast ränteben: erhålls årligen

Rörlig ränta: 6-månaders Euribor, betalas halvårsvis. Dagräkning: ACT/360

Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR

Rullningskonvention och kalender: standard

Effektivt datum samma som bokningsdag (dvs. det är räntorna vid marknadsstängning på bokningsdagen som ska användas).

Förfallodag: september år T+4.

EBA-instrumentets valuta: EUR

202. Tvåårig EUR-swaption på 5-årig EUR- ränteswapp – erhåll fast ränta och betala rörlig ränta.

Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR

Institutet är säljare av optionen på swappen. Institutets motpart köper rätten att ingå ett swapkontrakt med institutet. Om institutets motpart använder sig av rätten, ska motparten erhålla den fasta räntan medan institutet ska erhålla den rörliga räntan.

Swaption med tvåårig löptid (bokningsdag + 2 år) på ränteswapp definierad enligt följande: Fast ränteben – årlig betalning; Rörlig ränta: 6-månaders EURIBOR, erhålls kvartalsvis; Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR; Rullningskonvention och kalender: standard; Effektivt datum för den underliggande swappen: Bokningsdag + 2 år.

Förfallodag för den underliggande swappen: Bokningsdag + 7 år.

Premie som utbetalats på bokningsdagen (bokningsdag). Kontantavräknad.

Lösenpriset baseras på ATM-kursen för den terminsstartande swapen definierad i detta instrument

EBA-instrumentets valuta: EUR

203. 5-årig ränteswapp USD. Erhåll fast ränta och betala rörlig ränta.

Fast ränta: erhålls årligen

Rörlig ränta: 3-månaders USD SOFR, betalas kvartalsvis.

Teoretiskt värde: 1 000 000 USD

Rullningskonvention och kalender: standard

Effektivt datum samma som bokningsdag (dvs. det är räntorna vid marknadsstängning på bokningsdagen som ska användas).

Förfallodag: september år T+4.

EBA-instrumentets valuta: USD

204. 2-årig ränteswapp GBP. Erhåll fast ränta och betala rörlig ränta.

Fast ränta: erhålls årligen

Rörlig ränta: SONIA (daglåne)ränta läggs samman och betalas kvartalsvis. Dagräkning: Actual/365, helgdagskalender

Teoretiskt värde: 10 000 000 GBP

Rullningskonvention och kalender: standard

Effektivt datum samma som bokningsdag (dvs. det är räntorna vid marknadsstängning på bokningsdagen som ska användas).

Förfallodag: Bokningsdag + 2 år

EBA-instrumentets valuta:

205. 10-årig obligation med flytande minimi- och maximiränta såld av UBS

Teoretiskt (kapital)belopp: 1 000 000 USD.

Obligationerna med rörlig ränta är icke-efterställda osäkrade obligationer från UBS AG.

EBA-instrumentets valuta:

— Obligationerna kommer att bära en ränta med en årlig sats motsvarande USD tremånaders SOFR plus 1,5 % årlig rörlig ränta till en maximal räntesats på 7,5 % per år (räntetak) och en minimisats på 2,5 % per år (räntegolv).

— Alla eventuella utbetalningar från obligationerna, inklusive ränta och kapitalbeloppet på förfallodagen ska vara beroende av UBS AG:s kreditvärdighet. Instituten anmodas använda en lämplig diskonteringskurva och motivera sitt beslut i den förklarande anmärkningen.

— Inkomst: obligationerna kommer att utgå med ränta kvartalsvis till en sats som motsvarar den rörliga räntesatsen, förutsatt att i) den tillämpliga räntesatsen för den aktuella perioden, om den rörliga räntan på någon av kupongdagarna ligger under räntegolvet, är lika med räntegolvet, eller ii) den tillämpliga räntesatsen för den aktuella perioden, om den rörliga räntan på någon av kupongdagarna ligger över räntetaket, är lika med räntetaket.

| | |
|---|---|
| Räntebelopp som ska betalas | De räntebelopp som ska betalas ut från en obligation för en ränteperiod ska vara lika med produkten av a) obligationernas kapitalbelopp, b) den tillämpliga räntesatsen för den ränteperioden, och c) den kvot, vars täljare är antalet dagar i ränteperioden (beräknat på grundval av ett år om 360 dagar och tolv 30-dagars månader) och vars nämnare är 360. |
| Handels- och avvecklingsdag | Bokningsdag |
| Datum för betalning av ränta | Kvartalsvis, på bokningsdagen + 3 månader, bokningsdagen + 6 månader, bokningsdagen + 9 månader och bokningsdagen + 1 år, med början bokningsdagen + 3 månader under obligationernas löptid (med justeringar enligt vad som beskrivs här). |
| Förfallodag | Bokningsdag + 10 år |
| Valuta | USD |
| Dagberäkningsbas | 30/360 |
| Bankdagskonvention | Following Unadjusted (Följande ojusterat) |
| Kupongdatum Datum | För varje ränteperiod, den andra Londonbankdagen omedelbart före relevant räntedatum. Med ”Londonbankdag” avses en dag då affärsbanker har öppet för allmän verksamhet (inklusive handel med och insättning av utländsk valuta) i London och då transaktioner i US-dollar sker på Londons interbankmarknad. |

206. Lång position, GERMANY GOVT (inflation) 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030583).

Förfallodag: 15 april 2033

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Förfallodag: 15 augusti 2030

EBA-instrumentets valuta: EUR

208. Lång position, ITALY GOVT (inflation) 1 000 000 EUR (ISIN IT0005138828).

Förfallodag: 15 september 2032

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Förfallodag: 1 december 2028

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Förfallodag: 30 juli 2030

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Förfallodag: 25 maj 2031

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Förfallodag: 4 januari 2031

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Förfallodag: 7 juni 2032

EBA-instrumentets valuta: GBP

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

Förfallodag: 15 juni 2029

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Förfallodag: 15 november 2030

EBA-instrumentets valuta:

216. Lång position, BRAZIL GOVT (uppsägbar) 1 000 000 USD (ISIN US105756BZ27).

Förfallodag: 13 januari 2028

EBA-instrumentets valuta: USD

217. Lång position, MEXICO GOVT (uppsägbar) 1 000 000 USD (ISIN US91087BAT70).

Förfallodag: 19 maj 2033

EBA-instrumentets valuta:

218. 10-årig ränteswapp EURO – erhåll rörlig ränta och betala fast ränta.

Fast ränteben: betalas årligen

Rörlig ränta: 3-månaders Euribor, betalas kvartalsvis. Dagräkning: ACT/360

Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR

Rullningskonvention och kalender: standard

Effektivt datum som bokningsdatum (dvs. det är räntorna vid marknadsstängning på bokningsdagen som ska användas)

Förfallodag: Bokningsdag + 10 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

219. 5-årig ränteswapp EURO – erhåll rörlig ränta och betala fast ränta.

Fast ränteben: betalas årligen

Rörlig ränta: 6-månaders EURIBOR, betalas var 6:e månad. Dagräkning: ACT/360

Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR

Rullningskonvention och kalender: standard

Effektivt datum som bokningsdatum (dvs. det är räntorna vid marknadsstängning på bokningsdagen som ska användas)

Förfallodag: Bokningsdag + 5 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

220. 5-årig Mark to Market (MtM) valutaswapp EUR/USD. Erhåll USD och betala EUR.

EUR: EUR 3-månaders rörlig ränta (ESTER), erhålls kvartalsvis sammansatt med två dagars betalningsfördröjning. Dagräkning: ACT/360

USD: 3-månaders SOFR (Secured Overnight Financing rate), erhålls kvartalsvis sammansatt med två dagars betalningsfördröjning. Dagräkning: ACT/360

Ben 1 – USD: Teoretiskt värde 10 000 000 EUR motsvarande justerat på kvartalsbasis.

Ben 2 – EUR: Teoretiskt värde 10 000 000 EUR

Rullningskonvention och kalender: standard

Effektivt datum samma som bokningsdag + 6 månader

Förfallodag: Bokningsdag + 5,5 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

Se även avsnitt 6 i denna bilaga – Ytterligare specifikationer för instrument

221. 10-årig ränteswapp EURO erhåll rörlig ränta (ESTER) och betala EURIBOR.

ESTER-ränteben: erhålls årligen. Dagräkning: ACT/360

Euribor-ränteben: 3-månaders Euribor + bas, betalas kvartalsvis. Dagräkning: ACT/360

Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR

Rullningskonvention och kalender: standard

Effektivt datum samma som bokningsdag (dvs. det är räntorna vid marknadsstängning på bokningsdagen som ska användas).

Förfallodag: September år T + 9 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

222. Lång position, ITALY GOVT (inflation) 1 000 000 EUR (ISIN IT0005387052).

Förfallodag: 15 maj 2030

EBA-instrumentets valuta: EUR

223. 5-årig inflations-nollkupongswap EUR – Erhåll inflationsindexerad avkastning och betala fast ränta (r).

Inflationsindex: KPI (HIKPxT)

Fast ränteben (fast betalning): $[(1 + r)^5 - 1]$

Erhåll inflationsindexerad återbetalning: $\left[\left(\frac{CPI \text{ at the end (maturity) date}}{CPI \text{ at the start date}}\right) - 1\right]$

Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR

Basfixeringstermin: juni år T-1

Slutgiltig fixering: augusti år T+4

Förfallodag: september år T+4.

EBA-instrumentets valuta: EUR

224. Tvåårig EUR-swaption på 5-årig EUR-ränteswapp – erhåll fast ränta och betala rörlig ränta.

Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR

Institutet är säljare av optionen på swappen. Institutets motpart köper rätten att ingå ett swapkontrakt med institutet. Om institutets motpart använder sig av rätten, ska motparten erhålla den rörliga räntan medan institutet ska erhålla den fasta räntan.

Swaption med tvåårig löptid (bokningsdag + 2 år) på ränteswapp definierad enligt följande: Fast ränteben – erhåll årlig betalning; Rörlig ränta: 6-månaders Euribor, betalas var 6:e månad; Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR; Rullningskonvention och kalender: standard; Effektivt datum för den underliggande swappen: Bokningsdag + 2 år.

Förfallodag för den underliggande swappen: Bokningsdag + 7 år

Premie som utbetalats på bokningsdagen (bokningsdag). Kontantavräknad.

Lösenpriset baseras på ATM-kursen för den terminsstartande swapen definierad i detta instrument + 100 punkter

EBA-instrumentets valuta: EUR

**FX**

301. 6-månaders USD/EUR terminskontrakt (forward). Kontantavräknad. USD lång position – EUR kort position. Teoretiskt värde 10 000 000 USD. Lösenpris för terminer (forward): lika med 100 % av ECB:s referenskurs vid bokningsdagens slut.

EBA-instrumentets valuta: EUR

302. 6-månaders EUR/GBP terminskontrakt (forward). Kontantavräknad. EUR lång position – GBP kort position; Teoretiskt värde
10 000 000 GBP; Lösenpris för terminer (forward): lika med 100 % av ECB:s referenskurs vid bokningsdagens slut.

EBA-instrumentets valuta: EUR

303. Lång position 10 000 000 USD kontanter.

Kontantposition. Ska anses ha en inneboende valutarisk enligt beskrivningen i punkt (kk)

EBA-instrumentets valuta: EUR

304. Lång position EUR/USD i köpoption (USD lång position, EUR kort position). Kontantavräknad. Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR Motsvarande belopp baserat på EUR/USD till ECB:s referenskurs avista vid bokningsdagens slut.

Lösenpris: 110 % av EUR/USD till ECB:s referenskurs vid bokningsdagens slut.

Förfallodag: Bokningsdag + 1 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

305. Lång position EUR/USD i köpoption (USD lång position, EUR kort position). Kontantavräknad. Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR Motsvarande belopp baserat på EUR/USD till ECB:s referenskurs avista vid bokningsdagens slut.

Lösenpris: 90 % av EUR/USD till ECB-referenskurs vid bokningsdagens slut.

Förfallodag: Bokningsdag + 1 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

306. Kort position EUR/USD i köpoption (EUR kort position, USD lång position). Kontantavräknad. Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR Motsvarande belopp baserat på EUR/USD till ECB:s referenskurs avista vid bokningsdagens slut.

Lösenpris: 100 % av EUR/USD till ECB-referenskurs vid bokningsdagens slut.

Förfallodag: Bokningsdag + 1 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

307. Kort position EUR/GBP i köpoption (EUR kort position, GBP lång position). Kontantavräknad. Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR Motsvarande belopp baserat på EUR/GBP till ECB:s referenskurs avista vid bokningsdagens slut.

Lösenpris: 110 % av EUR/GBP till ECB:s referenskurs vid bokningsdagens slut.

Förfallodag: Bokningsdag + 1 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

308. Lång position EUR/JPY i säljoption (EUR kort position, JPY lång position). Kontantavräknad. Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR Motsvarande belopp baserat på EUR/JPY till ECB:s referenskurs avista vid bokningsdagens slut.

Lösenpris: 110 % av EUR/JPY till ECB:s referenskurs vid bokningsdagens slut.

Förfallodag: Bokningsdag + 1 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

309. Kort position EUR/AUD i säljoption (EUR lång position, AUD kort position). Kontantavräknad. Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR Motsvarande belopp baserat på EUR/AUD till ECB:s referenskurs avista vid bokningsdagens slut.

Lösenpris: 110 % av EUR/AUD till ECB:s referenskurs vid bokningsdagens slut.

Förfallodag: Bokningsdag + 1 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

310. 6-månaders EUR/DKK terminskontrakt (forward) (EUR lång position, DKK kort position). Kontantavräknad. Teoretiskt värde 10 000 000 EUR. EUR/DKK till ECB:s referenskurs avista vid bokningsdagens slut för att fastställa terminskursen.

EBA-instrumentets valuta: EUR

311. 6-månaders EUR/BRL terminskontrakt (forward) (EUR lång position, BRL kort position). Teoretiskt värde 10 000 000 EUR. EUR/BRL till ECB:s referenskurs avista vid bokningsdagens slut för att fastställa terminskursen.

EBA-instrumentets valuta: EUR

**RÅVAROR**

401. Lång position, 6-månaders
3 500 troy ounces London guldtermin (forward) (guld lång position, USD kort position). Kontantavräknad. Lösenpris: 6-månaders terminspris (forward) vid dagens slut på bokningsdagen

EBA-instrumentets valuta: USD

402. Kort position, 12-månaders 3 500 troy ounces London guldtermin (forward) (guld kort position, USD lång position). Kontantavräknad. Lösenpris: 12-månaders terminspris (forward) vid dagens slut på bokningsdagen

EBA-instrumentets valuta: USD

403. Lång position i köpoption 30 000 fat Brent-råolja (WTI lång position, USD kort position). Kontantavräknad. Lösenpris: 12-månaders terminspris (forward) vid dagens slut på bokningsdagen Förfallodag: Bokningsdag + 6 månader

EBA-instrumentets valuta:

404. Kort position i säljoption 30 000 fat Brent-råolja (WTI lång position, USD kort position). Kontantavräknad. Lösenpris: 12-månaders terminspris (forward) vid dagens slut på bokningsdagen Förfallodag: Bokningsdag + 6 månader

EBA-instrumentets valuta:

405. Lång position i köpoption 5 000 troy ounces London guld (guld lång position, USD kort position). Kontantavräknad. Lösenpris: 18-månaders terminspris (forward) vid dagens slut på bokningsdagen Förfallodag: Bokningsdag + 18 månader

EBA-instrumentets valuta: USD

**KREDITSPREAD**

501. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för PORTUGAL.

Omstruktureringsklausul: FULLSTÄNDIG

EBA-instrumentets valuta: USD

502. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för ITALIEN.

Omstruktureringsklausul: FULLSTÄNDIG
EBA-instrumentets valuta: USD

503. Kort position (dvs. sälj skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för SPANIEN.

Omstruktureringsklausul: FULLSTÄNDIG
EBA-instrumentets valuta: USD

504. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för MEXIKO.

Omstruktureringsklausul: FULLSTÄNDIG
EBA-instrumentets valuta: USD

505. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för BRASILIEN.

Omstruktureringsklausul: FULLSTÄNDIG
EBA-instrumentets valuta: USD

506. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för FÖRENADE KUNGARIKET.

Omstruktureringsklausul: FULLSTÄNDIG
EBA-instrumentets valuta: USD

507. Kort position (dvs. sälj skydd), 1 000 000 EUR kreditswapp för Telefonica (Ticker TEF SM).

EBA-instrumentets valuta: EUR

508. Kort position (dvs. köp skydd), 1 000 000 EUR kreditswapp för Telefonica (Ticker TEF SM).

Förfallodag: december år T+2.
EBA-instrumentets valuta: EUR

509. Kort position (dvs. sälj skydd), 1 000 000 EUR kreditswapp för Aviva (Ticker AV/LN).

ISDA-definitioner år 2003
EBA-instrumentets valuta: EUR

510. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 EUR kreditswapp för Aviva (Ticker AV/LN)

ISDA-definitioner år 2003
Förfallodag: december år T+2.
EBA-instrumentets valuta: EUR

511. Kort position (dvs. sälj skydd), 1 000 000 EUR kreditswapp för Vodafone (Ticker VOD LN).

EBA-instrumentets valuta: EUR

512. Kort position (dvs. sälj skydd), 1 000 000 EUR kreditswapp för ENI SpA (Ticker ENI IM).

EBA-instrumentets valuta: EUR

513. Kort position (dvs. sälj skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för Eli Lilly (Ticker LLY US).

Omstruktureringsklausul: Ingen omstrukturering (XR14)
EBA-instrumentets valuta: USD

514. Kort position (dvs. sälj skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för Eli Lilly (Ticker LLY US).

EBA-instrumentets valuta: EUR

515. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 EUR kreditswapp för Total SA (Ticker FP FP).

EBA-instrumentets valuta: EUR

516. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 EUR kreditswapp för Volkswagen Group (Ticker VOW GR).

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Förfallodag: 26 april 2029

EBA-instrumentets valuta: USD

518. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för TURKIET. Effektivt datum samma som bokningsdag.

Omstruktureringsklausul: FULLSTÄNDIG

EBA-instrumentets valuta: USD

519. Lång position i Telefonica-obligationer 1 000 000 EUR (ISIN XS1681521081).

Förfallodag: 12 januari 2028

EBA-instrumentets valuta: EUR

520. Lång position i Volkswagen Group-obligationer 1 000 000 EUR (ISIN XS2234567233).

Förfallodag: 22 september 2028

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Förfallodag: 16 januari 2030

EBA-instrumentets valuta: EUR

522. Lång position i Total SA-obligationer 1 000 000 EUR (ISIN XS1856281834).

Förfallodag: 11 juli 2033

EBA-instrumentets valuta: EUR

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

Förfallodag: 15 mars 2037

EBA-instrumentets valuta: EUR

524. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för ÖSTERRIKE.

Förfallodag: juni år T+15.

EBA-instrumentets valuta: USD

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

Förfallodag: 15 januari 2040

EBA-instrumentets valuta: EUR

526. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för NEDERLÄNDERNA.

Förfallodag: juni år T+20.

EBA-instrumentets valuta: USD

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

Förfallodag: 22 juni 2050

EBA-instrumentets valuta: EUR

528. Lång position (dvs. köp skydd), 1 000 000 USD kreditswapp för BELGIEN.

Förfallodag: juni år T+30.

EBA-instrumentets valuta: USD

529. Lång position (dvs. köp skydd) 10 000 000 EUR kreditswapp för iTraxx Europe index senast on-the-run series.

Förfallodag: juni år T+4.

EBA-instrumentets valuta: EUR

530. Kort position i säljoption. 10 000 000 EUR Underliggande iTraxx Europe index on-the-run series (samma instrument som i 529).

Lösenpris: ATM

Förfallodag: Bokningsdag + 6 månader

EBA-instrumentets valuta: EUR

531. Lång position, AXA SA (uppsägbar) 1 000 000 EUR (ISIN XS1799611642).

Förfallodag: 28 maj 2049

EBA-instrumentets valuta: EUR

532. Lång position, AT&T-obligation (uppsägbar) 1 000 000 USD (ISIN US00206RFW79).

Förfallodag: 15 augusti 2037

EBA-instrumentets valuta: USD

533. Lång position, BAYER AG (uppsägbar) 1 000 000 EUR (ISIN XS2199266268).

Förfallodag: 6 januari 2030

EBA-instrumentets valuta: EUR

534. Lång position, ORANGE SA (uppsägbar) 1 000 000 EUR (ISIN FR0013323870).

Förfallodag: 20 mars 2028

EBA-instrumentets valuta: EUR

**KHP**

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

Fästpunkt: 3%

Avskiljningspunkt: 6%

Teoretiskt värde: 5 000 000 EUR

Förfallodag: 5 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

602. Lång position (dvs. köp skydd) 5 000 000 EUR kreditswapp för iTraxx Europe index senast on-the-run series.

Förfallodag: juni år T+4.

EBA-instrumentets valuta: EUR

Teoretisk justering för att till fullo skydda CS01 i 601 utan att omsäkring krävs

603. Lång position (dvs. köp skydd) i iTraxx Europe index on-the-run series.

Fästpunkt: 3%

Avskiljningspunkt: 6%

Teoretiskt värde: 5 000 000 EUR

Förfallodag: 5 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

604. Kort position (dvs. sälj skydd) 5 000 000 EUR kreditswapp för iTraxx Europe index on-the-run series.

Förfallodag: juni år T+4.

EBA-instrumentets valuta: EUR

Teoretisk justering för att till fullo skydda CS01 i 603 utan att omsäkring krävs

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

Fästpunkt: 12%

Avskiljningspunkt: 100%

Teoretiskt värde: 5 000 000 EUR

Förfallodag: 5 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

606. Lång position (dvs. köp skydd) 5 000 000 EUR kreditswapp för iTraxx Europe index senast on-the-run series.

Förfallodag: juni år T+4.

EBA-instrumentets valuta: EUR

Teoretisk justering för att till fullo skydda CS01 i 605 utan att omsäkring krävs

607. Lång position (dvs. köp skydd) i iTraxx Europe index on-the-run series.

Fästpunkt: 12%

Avskiljningspunkt: 100%

Teoretiskt värde: 5 000 000 EUR

Förfallodag: 5 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

608. Kort position (dvs. sälj skydd) 5 000 000 EUR kreditswapp för iTraxx Europe index on-the-run series.

Förfallodag: juni år T+4.

EBA-instrumentets valuta: EUR

Teoretisk justering för att till fullo skydda CS01 i 607 utan att omsäkring krävs

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

Fästpunkt: 3%

Avskiljningspunkt: 6%

Teoretiskt värde: 5 000 000 EUR

Förfallodag: 5 år

EBA-instrumentets valuta: EUR

Återvinningsgrad: 40 % fast

610. Lång position (dvs. köp skydd) 5 000 000 EUR kreditswapp för iTraxx Europe index senast on-the-run series.

Förfallodag: juni år T+4.

EBA-instrumentets valuta: EUR

Teoretisk justering för att till fullo skydda CS01 i 609 utan att omsäkring krävs

### Avsnitt 3: Individuella portföljer – Ett enda instrument

Institut ska tillhandahålla nödvändiga riskmått samt nuvärdet (PV) för följande individuella portföljer:

| Portfölj | *Kombination av instrument:*<br>Den första siffran står för instrumentet (se avsnitt 2 i denna bilaga).<br>Den andra siffran står för kvantiteten av varje instrument eller antal kontrakt, beroende på vad som är tillämpligt. | EBA-portföljens valuta | Riskmått krävs |
|---|---|---|---|
| 1001 | 101 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1002 | 102 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1003 | 103 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1004 | 104 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1005 | 105 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1006 | 106 – 1 instrument | GBP | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1007 | 107 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1008 | 108 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1009 | 109 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1010 | 110 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1011 | 111 – 1 instrument | USD | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1012 | 112 – 1 instrument | USD | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1013 | 113 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1014 | 114 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1015 | 115 – 1 instrument | GBP | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1016 | 116 – 1 instrument | GBP | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1017 | 117 – 1 instrument | JPY | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1018 | 118 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |

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

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

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

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

**Avsnitt 4: Individuella portföljer – Flera instrument**

Institut ska tillhandahålla nödvändiga riskmått samt nuvärdet (PV) för följande individuella portföljer:

| Portfölj | *Kombination av instrument:*<br>Den första siffran står för instrumentet (se avsnitt 2 i denna bilaga).<br>Den andra siffran står för kvantiteten av varje instrument eller antal kontrakt, beroende på vad som är tillämpligt. | EBA-portföljens valuta | Riskmått krävs |
|---|---|---|---|
| 1101 | 103 – 1 instrument<br>104 – 1 instrument<br>105 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1102 | 113 – 1 instrument<br>110 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1103 | 115 – 1 instrument<br>116 – 1 instrument | GBP | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 1104 | 109 – 1 instrument<br>110 – 1 instrument | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |

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

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

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

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

**Avsnitt 5: Aggregerade portföljer**

Institut ska tillhandahålla nödvändiga riskmått samt nuvärdet (PV) för följande aggregerade portföljer:

| Aggreg. portfölj | Beskrivning | Kombination av individuella portföljer (se numren för individuella portföljer i avsnitten 3 och 4 i denna bilaga) | EBA-portföljens valuta | Riskmått krävs |
|---|---|---|---|---|
| 10000 | ALL-IN nr-KHP | 1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521 | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 11000 | AKTIER, kumulativt | 1001, 1101, 1104, 1106 | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 12000 | IR kumulativt | 2001, 2002, 2203, 2206 | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 13000 | Valuta, kumulativt | 3301, 3303, 3304 | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 14000 | Råvaror, kumulativt | 4401, 4402 | USD | VaR; Stressjusterat VaR; SBM; DRC; RRAO |
| 15000 | Kreditspread kumulativt | 5503, 5506, 5508, 5521 | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO |
| 16000 | KHP kumulativt EUR | 6601, 6602 | EUR | VaR; Stressjusterat VaR; APR; SBM; DRC; RRAO |

**Avsnitt 6: Ytterligare specifikationer för instrument**

Instituten ska tillämpa följande ytterligare specifikationer på de finansiella instrument som beskrivs i avsnitt 2 i denna bilaga.

| | |
|---|---|
| Instrument | 220 |
| Beskrivning: | 5-årig Mark to Market (MtM) valutaswapp EUR/USD.<br>Erhåll USD och betala EUR.<br>Teoretiskt värde: 10 000 000 EUR, USD (10 000 000 EUR * FX USD/EUR) |
| Betala: | Rörl. ben 2 |
| Erhåll: | Rörl. ben 1 |
| Utbyte och återställning av teoretiskt belopp: | På effektivt datum och förfallodag. Varje kupongutbetalningsdag görs dessutom en ytterligare betalning motsvarande justeringen av det teoretiska värdet i USD för rörl. ben 2. Teoretiskt värde i USD justeras för att motsvara 10 000 000 EUR till avistakurs 2 bankdagar före varje betalningsdag. |
| Kassabehållning | Inkluderad |
| *Rörl. ben 1* | |
| Teoretiskt värde: | Motsvarande 10 000 000 EUR konverterat till USD till avistakurs på effektivt datum, motsvarigheten justerad kvartalsvis |
| Effektivt datum: | Bokningsdag + 6 månader |
| Förfallodag: | Bokningsdag + 5,5 år |
| Generering av betalningsdag: | Framåt från effektivt datum: |
| Kupongbetalningsfrekvens | Kvartalsvis |
| Kupongränta: | 3-månaders SOFR + 0 punkter. |
| Frekvens för återställning av kupongränta: | Kvartalsvis |
| Konvention för fastställande av kupongränta: | Sammanräknas dagligen under en tremånadersperiod |
| Frekvens för sammansatt kupongränta; | Enkel ränta |
| Dagräkning: | ACT/360 |
| Betalningsdag: | LON, NYC, TARGET |
| Betalningsdagskonvention: | Följande bankdag, ändrat |
| Bankdag för återställning av teoretiskt belopp: | LON, NYC, TARGET |
| Bankdagskonvention för återställning av teoretiskt belopp: | Föregående |
| Bankdag för återställning av kupongränta: | LON, NYC, TARGET |
| Bankdagskonvention för återställning av kupongränta: | Föregående |
| | |

| | |
|---|---|
| *Rörl. ben 2* | |
| Teoretiskt värde: | 10 000 000 EUR |
| Effektivt datum: | Bokningsdag + 6 månader |
| Förfallodag: | Bokningsdag + 5,5 år |
| Generering av betalningsdag: | Framåt från effektivt datum: |
| Kupongbetalningsfrekvens | Kvartalsvis |
| Kupongränta: | 3-månaders rörlig ränta (Ester) + 0 punkter. |
| Frekvens för återställning av kupongränta: | Kvartalsvis |
| Konvention för fastställande av kupongränta: | ammanräknas dagligen under en tremånadersperiod |
| Frekvens för sammansatt kupongränta; | Enkel ränta |
| Dagräkning: | ACT/360 |
| Betalningsdag: | LON, NYC, TARGET |
| Betalningsdag: | Följande bankdag, ändrat |
| Bankdag för återställning av teoretiskt belopp: | LON, NYC, TARGET |
| Bankdagskonvention för återställning av teoretiskt belopp: | Föregående |
| Bankdag för återställning av kupongränta: | LON, NYC, TARGET |
| Bankdagskonvention för återställning av kupongränta: | Föregående |

**Avsnitt 7: SBM-valideringsportföljer**

a) Som en del av IMV-inlämningen ska instituten lämna in SBM-riskmått för de portföljer som definieras i bilaga X (SBM-valideringsportföljer) och lämna in dem i överensstämmelse med rapporteringsdatumen för IMV-inlämningen.

b) Följande ska gälla för inlämnandet av de resultaten som avser SBM-valideringsportföljerna:

   i) Instituten ska endast rapportera mall C120.02 och begränsa rapporteringen i denna mall till resultaten uttryckta i rapporteringsvaluta (dvs. kolumn 0060 i mall C120.02 ska inte fyllas i, och mallarna C 106.00 och C 106.01 ska inte rapporteras för SBM-valideringsportföljerna).

   ii) Instituten ska anta att riskkänsligheterna och kurvriskexponeringarna definierade av de instrument som anges i bilaga X uttrycks i institutens rapporteringsvaluta och att uppgifterna anges i det format som fastställs i rapporteringsinstruktionerna för mallarna C 106.01 / C 120.01 och motsvarande tabell med riktlinjer för rapportering av dessa mallar i bilaga VI (mallinstruktioner).”

*BILAGA III*

*”BILAGA VI*

**REFERENSPORTFÖLJER FÖR TILLSYNSÄNDAMÅL – RESULTAT**

**MALLRELATERADE ANVISNINGAR**

C 106.00 – Initial marknadsvärdering och motivering till uteslutning ....57
C 106.01 – Känslighetsbaserad metod (SBM). Riskkänslighet per instrument ....57
C 107.01 - VaR och sVaR - Icke-CTP. Uppgifter ....61
C 107.02 - VaR, sVaR och nuvärde (PV) - Icke-KHP. Resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta ....63
C 108.00 - Resultat - tidsserier ....64
C 109.01 – Kapitalkrav för tillkommande fallissemangs- och migrationsrisk (IRC). Uppgifter om modellen ....65
C 109.02 – Kapitalkrav för tillkommande fallissemangs- och migrationsrisk (IRC). Uppgifter per portfölj ....65
C 109.03 – Kapitalkrav för tillkommande fallissemangs- och migrationsrisk (IRC). Belopp per portfölj/datum ....66
C 110.01 — Korrelationshandel: uppgifter om modellen ....67
C 110.02 — Korrelationshandel: uppgifter per portfölj ....68
C 110.03 – Korrelationshandel: APR per portfölj/datum ....69
C 120.01 – Känslighetsbaserad metod (SBM). RISKKÄNSLIGHET PER INSTRUMENT/PORTFÖLJ ....69
C 120.02 – Känslighetsbaserad metod (SBM). KAPITALBASKRAV (OFR) FÖR TOTAL EXPONERING PER PORTFÖLJ ...72
C 120.04 – DRC. MARKNADSVÄRDEN OCH BRUTTOBELOPP VID PLÖTSLIGT FALLISSEMANG PER INSTRUMENT/PORTFÖLJ ....74
C 120.05 – DRC. KAPITALBASKRAV (OFR) FÖR TOTAL EXPONERING PER PORTFÖLJ ....80
C 120.06 — ASA. OFR (kapitalbaskrav) ....82

**MALLRELATERADE ANVISNINGAR**

### C 106.00 – Initial marknadsvärdering och motivering till uteslutning

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Instrumentnummer | Avsnitt 2 i bilaga V | Instrumentnumret från bilaga V ska rapporteras. |
| 0020 | Instrument modellerat för VaR och sVaR (JA/NEJ) | | Ange JA eller NEJ. |
| 0030 | Instrument modellerat för IRC (JA/NEJ) | | Ange JA eller NEJ. |
| 0040 | Instrument modellerat för korrelationshandel (JA/NEJ) | | Ange JA eller NEJ. |
| 0050 | Skäl för uteslutning | Artikel 3.2 | Ange ett av följande alternativ:<br>(a) Modellen godkänns ej av tillsynsmyndigheten.<br>(b) Instrumentet eller det underliggande är inte godkänt internt.<br>(c) Egenskaperna hos modellen eller det underliggande har inte beaktats internt.<br>(d) Annat skäl för uteslutning. Ange detta skäl i kolumn 0060. |
| 0060 | Fritextfält | | Instituten kan lämna ytterligare information i denna kolumn. |
| 0070 | Initial marknadsvärdering (IMV) | | Det aktuella marknadsvärdet för varje instrument på referensdagen kl. 17.30 MET (på det sätt som avses i avsnitt 1 b i bilaga V.<br>Fältet ska lämnas tomt om institutet inte vill lämna IMV för en särskild portfölj (dvs. noll-värden ska endast rapporteras om det belopp som följer av beräkningen är noll). |

### C 106.01 – Känslighetsbaserad metod (SBM). Riskkänslighet per instrument

Institut ska rapportera känsligheterna för de riskfaktorer som instrumentet är exponerat för. En rad ska rapporteras per riskfaktor/känslighet. Den riskfaktorns nettokurvriskposition (uppåt) (CVRk+) eller den riskfaktorns nettokurvriskposition (nedåt) (CVRk-) på det sätt som anges i artikel 325g i förordning (EU) nr 575/2013 ska rapporteras på separata rader. Alla värden ska hänvisa till ”IMV-referensdatumet (och första SBM-referensdatumet)” på det sätt som anges i avsnitt 1 punkt b ii i bilaga V till denna förordning. Instituten ska rapportera varje kombination av instrumentnummer, riskidentifierare (kolumn 0010), undergrupp (kolumn 0020) och ytterligare identifierare (kolumn 0030) endast en gång.

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Instrumentnummer | Avsnitt 2 i bilaga V | Instrumentnumret från bilaga V ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Riskfaktoridentifierare | Artiklarna 325l, 325m, 325n, 325o, 325p och 325q i förordning (EU) nr 575/2013 | Den riskfaktoridentifierare som anges i tabellen i slutet av denna bilaga ska rapporteras. |
| 0020 | Undergrupp | Artikel 325d.3 i förordning (EU) nr 575/2013 | Undergruppen ska rapporteras när den riskfaktoridentifierare som väljs i kolumn 0010 motsvarar riskklassen:<br>— Vid generell ränterisk ska svaret vara namnet på den relevanta riskfria räntans valuta, inflationen eller valutariskfaktorn (enligt valutabenämningen ISO 4217, t.ex. ”EUR”).<br>— Vid kreditspreadrisk för icke-värdepapperiseringar ska svaret vara undergruppens nummer i tabell 4 i artikel 325ah.1 i förordning (EU) nr 575/2013.<br>— Vid kreditspreadrisk för värdepapperiseringar eller som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen (icke-ACTP CSR) ska svaret vara undergruppens nummer i tabell 7 i artikel 325am.1 i den förordningen.<br>— Vid kreditspreadrisk för värdepapperiseringar eller som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen (ACTP CSR) ska svaret vara undergruppens nummer i tabell 6 i artikel 325ak i den förordningen.<br>— Vid aktiekursrisk ska svaret vara undergruppsnumret i tabell 8 i artikel 325ap.1 i den förordningen.<br>— Vid råvarurisk ska svaret vara undergruppsnumret i tabell 9 i artikel 325as i den förordningen.<br>— Vid valutarisk (FX) och komponenterna Delta eller kurvrisk (Curvature) ska svaret vara valutanamnet (t.ex. ”USD”, rapporteringsvalutans koder ska utformas enligt valutabenämningen ISO 4217).<br>— Vid valutarisk och vegakomponenten ska svaret vara valutanamnet (t.ex. ”EUR_USD”, rapporteringsvalutans koder ska utformas enligt valutabenämningen ISO 4217). |
| 0030 | Ytterligare identifierare | Artiklarna 325l-325q och 325ai i förordning (EU) nr 575/2013 | Följande uppgifter som urskiljer riskfaktorn på undergruppsnivå ska rapporteras. När den riskfaktoridentifierare som väljs i kolumn 0010 motsvarar riskklassen, gäller följande:<br>— Vid generell ränterisk samt deltakomponenten ska svaret vara namnet på den riskfria kurvan eller någon annan motsvarande unik identifierare.<br>— Vid kreditspreadrisk för icke-värdepapperiseringar eller kreditspreadrisk per riskklass för värdepapperiseringar som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen ska svaret vara utställarens namn eller någon annan motsvarande unik |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | identifierare, och vara identiskt för två rapporterade känsligheter för två riskfaktorer som erhåller korrelationsparametern $\rho_{kl}^{(namn)}$ lika med 1 i enlighet med artikel 325ai.1 i förordning (EU) nr 575/2013.<br>— Vid kreditspreadrisk för värdepapperiseringar eller som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen ska svaret vara tranchbenämningen eller någon annan motsvarande unik identifierare.<br>— Vid aktiekursrisk ska svaret vara utställarens namn eller någon annan motsvarande unik identifierare.<br>— Vid råvarurisk ska svaret vara råvarans benämning eller någon annan motsvarande unik identifierare.<br>Om inget av ovanstående fall är tillämpliga, ska institutet rapportera ett uttryckligt värde (NULL) som anger ej tillämpligt. |
| 0050 | Riskkänslighet (resultat uttryckt i rapporteringsvaluta) | Artikel 325d.2 samt artiklarna 325g, 325r, 325s, 325 t och 325ax i förordning (EU) nr 575/2013 | Riskkänsligheter (delta-/vegakänsligheter och kurvriskpositioner) ska rapporteras på respektive instrumentnivå för samtliga relevanta riskfaktorer på det sätt som anges i kolumnerna 0010–0030. Värdena ska rapporteras i institutets rapporteringsvaluta. När den riskfaktoridentifierare som väljs i kolumn 0010 motsvarar följande:<br>— För den känslighetsbaserade metodens deltariskkomponent ska nettokänsligheten för riskfaktorn ($S_k$) på det sätt som anges i artikel 325r i förordning (EU) nr 575/2013 rapporteras. Om instituten har fått tillstånd av sina behöriga myndigheter att använda alternativa definitioner av deltariskkänsligheter i enlighet med artikel 325t.5 i den förordningen, ska de hänvisa till de alternativa definitionerna för rapporteringen.<br>— För den känslighetsbaserade metodens vegariskkomponent ska vegariskkänsligheten för en given riskfaktor ($S_k$) på det sätt som anges i artikel 325s i förordning (EU) nr 575/2013 rapporteras. Om instituten har fått tillstånd av sina behöriga myndigheter att använda alternativa beräkningar av vegariskkänsligheter i enlighet med artikel 325t.6 i den förordningen, ska de hänvisa till de alternativa beräkningarna för rapporteringen. Oavsett om definitionerna i artikel 325s eller en alternativ beräkning i enlighet med artikel 325t.6 i den förordningen används av instituten, ska känsligheten rapporteras efter viktning med den tillhörande implicita volatiliteten.<br>— Den känslighetsbaserade metodens kurvriskkomponent, den riskfaktorns nettokurvriskposition (uppåt) ($CVR_k^+$) eller den riskfaktorns nettokurvriskposition (nedåt) ($CVR_k^-$) på det sätt som anges i artikel 325g i förordning (EU) nr 575/2013 ska rapporteras.<br>Den rapporterade uppgiften ska uttryckas som ett decimaltal med minst två decimalers noggrannhet.<br>Nollvärden ska rapporteras endast om det belopp som följer av beräkningen är noll. |
| 0060 | Rapporteringsvaluta | | Namnet på institutets rapporteringsvaluta ska rapporteras (rapporteringsvalutan ska anges enligt valutaidentifiering ISO 4217, t.ex. ”EUR”). |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0070 | Riskkänslighet (resultat uttryckt i EBA-instrumentets valuta) | Avsnitt 2 i bilaga V till denna förordning och artikel 325d.2 samt artiklarna 325g, 325r och 325s i förordning (EU) nr 575/2013 | Värdena ska rapporteras enligt anvisningarna för kolumn 0050 men översatta enligt den ECB-avistaväxelkurs som gäller valutan kopplad till det instrumentet på det sätt som anges i avsnitt 2 i bilaga V till denna förordning. |
| 0080 | Prissättningsmodell | Artikel 325t i förordning (EU) nr 575/2013 | Institutet ska ange vilken prissättningsmodell som tillämpas för att härleda känsligheter. Ange ett av följande alternativ:<br>a) ”Institutets prissättningsmodeller som utgör grunden för resultatrapporteringen till den verkställande ledningen” (i enlighet med artikel 325t.1 första stycket i förordning (EU) nr 575/2013).<br>b) ”Institutets internmodellmetod” (i enlighet med artikel 325t.1 andra stycket i den förordningen). |
| 0090 | Känslighetsdefinition | Artiklarna 325r, 325s och 325t i förordning (EU) nr 575/2013 | Institutet ska ange vilken känslighetsdefinition som tillämpas i beräkningen av kapitalbaskraven.<br>Ange ett av följande alternativ:<br>a) ”Känslighetsdefinition i artiklarna 325r och 325s i förordning (EU) nr 575/2013”.<br>b) ”Känslighetsdefinition i enlighet med artikel 325t.5 och 325t.6 i förordning (EU) nr 575/2013”.<br>Om den riskfaktoridentifierare som valts i kolumn 0010 motsvarar den känslighetsbaserade metodens kurvriskkomponent, ska det värde som anges i b rapporteras, om någon av de känsligheter som används i beräkningen av den rapporterade kurvriskpositionen baseras på en känslighetsdefinition i enlighet med artikel 325t.5 och 325t.6 i förordning (EU) nr 575/2013, annars ska det värde som anges i a rapporteras. |
| 0100 | Fritextfält | | I den här kolumnen får ett institut tillhandahålla ytterligare information om vilken prissättningsmodell och känslighetsdefinition som tillämpas. |
| 0110 | Ytterligare identifierare2 | Artikel 325p.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den riskfaktoridentifierare som valts i kolumn 0010 motsvarar riskklassens varurisk och den känslighetsbaserade metodens kurvriskkomponent, ska svaret vara de rättsliga villkoren avseende leveransorten eller en annan motsvarande unik identifierare.<br>Om inget av ovanstående fall är tillämpligt, ska institutet rapportera ett uttryckligt värde (NULL) som anger ej tillämpligt. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0120 | Kreditkvalitetkategori | Artikel 325m.1 och artikel 325ah.1 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den riskfaktoridentifierare som valts i kolumn 0010 motsvarar riskklassens kreditspreadrisk för icke-värdepapperisering och den känslighetsbaserade metodens kurvriskkomponent, ska svaret vara ett av följande:<br>a) ”Kreditkvalitetssteg 1”.<br>b) ”Kreditkvalitetssteg 2”.<br>c) ”Kreditkvalitetssteg 3”.<br>d) ”Kreditkvalitetssteg 4”.<br>e) ”Kreditkvalitetssteg 5”.<br>f) ”Kreditkvalitetssteg 6”.<br>g) ”Inget kreditkvalitetssteg har tilldelats (Utan kreditvärdering)”.<br>Om inget av ovanstående fall är tillämpligt, ska institutet rapportera ett uttryckligt värde (NULL) som anger ej tillämpligt. |

**C 107.01 – VaR och sVaR – Icke-CTP. Uppgifter**

| Rad | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 - 0060 | Value at Risk (VaR) | | |
| 0010 | Metod | | Ange ett av följande alternativ i kolumn 0010:<br>a) Historisk simulering.<br>b) Montecarlo.<br>c) Parametrisk metod.<br>d) Kombination / annan metod (ange vilken).<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. Om alternativ d valdes i kolumn 0010 ska institutet ange närmare uppgifter i kolumn 0020. |
| 0020 | Beräkning av 10-dagarsperiod | Artikel 365.1 i förordning (EU) nr 575/2013 | Ange ett av följande alternativ i kolumn 0010:<br>a) 1 dag skalreviderad till 10 dagar.<br>b) 10 dagar med överlappande perioder.<br>c) 10 dagar, övriga metoder.<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. |
| 0030 | Observationsperiodens längd | Artikel 365.1 d i förordning (EU) nr 575/2013 | Ange ett av följande alternativ i kolumn 0010:<br>a) Upp till 1 år.<br>b) Mer än 1 år och upp till 2 år.<br>c) Mer än 2 år och upp till 3 år.<br>d) Mer än 3 år.<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. |

| Rad | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0040 | Viktning av data | Artikel 365.1 d i förordning (EU) nr 575/2013 | Ange ett av följande alternativ i kolumn 0010:<br>a) Oviktat (viktning av VaR-data).<br>b) Viktat (viktning av VaR-data).<br>c) Det större av det viktade respektive oviktade (viktning av VaR-data) måttet i a och b.<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. |
| 0050 | Addend enligt utfallstest | Artikel 366.2 i förordning (EU) nr 575/2013, | Addend enligt utfallstest innebär en addend mellan 0 och 1 i enlighet med tabell 1 i artikel 366.2 i förordning (EU) nr 575/2013.<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. |
| 0060 | VaR föreskriven addend | Artikel 366.2 i förordning (EU) nr 575/2013 (”minst 3”) | Föreskriven addend är den extra kostnad som den behöriga myndigheten tar ut med avseende på multiplikationsfaktorn för VaR (minst lika med 3) i enlighet med artikel 366.2 i förordning (EU) nr 575/2013. VaR föreskriven addend är summan av addend enligt utfallstest och kvalitativ addend, i tillämpliga fall, över 3.<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. |
| 0070-0100 | SVaR (dvs. stressjusterat VaR) | | |
| 0070 | Metod | | Ange ett av följande alternativ i kolumn 0010:<br>a) Historisk simulering.<br>b) Montecarlo.<br>c) Parametrisk metod.<br>d) Kombination / annan metod (ange vilken).<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. Om alternativ d valdes i kolumn 0010 ska institutet ange närmare uppgifter i denna kolumn 0020. |
| 0080 | Beräkning av 10 dagarsperiod | Artikel 365.1 i förordning (EU) nr 575/2013 | Ange ett av följande alternativ i kolumn 0010:<br>a) 1 dag skalreviderad till 10 dagar.<br>b) 10 dagar med överlappande perioder.<br>c) 10 dagar, övriga metoder.<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. |
| 0090 | sVaR föreskriven addend | Artikel 366.2 i förordning (EU) nr 575/2013, | Föreskriven addend är den extra kostnad som den behöriga myndigheten tar ut med avseende på multiplikationsfaktorn för sVaR (minst lika med 3) i enlighet med artikel 366.2 i förordning (EU) nr 575/2013. Föreskriven addend är summan av 3, addend enligt utfallstest och kvalitativ addend (i tillämpliga fall). |

| Rad | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. |
| 0100 | SVaR-period | Artikel 365.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Ange ett av följande alternativ i kolumn 0010:<br>a) Daglig beräkning av stressjusterat VaR kalibrerat till en sammanhängande 12-månadersperiod fr.o.m. det datum som anges i kolumn 0020.<br>b) Veckovis beräkning av stressjusterat VaR kalibrerat till en sammanhängande 12-månadersperiod fr.o.m. det datum som anges i kolumn 0020.<br>c) Daglig beräkning av stressjusterat VaR kalibrerat till olika sammanhängande 12-månadersperioder under de rapporteringsdatum för stressjusterat VaR som anges i kolumn 0010 i C107.02 fr.o.m. de datum som anges i kolumn 0020.<br>d) Veckovis beräkning av stressjusterat VaR kalibrerat till olika sammanhängande 12-månadersperioder under de rapporteringsdatum för stressjusterat VaR som anges i kolumn 0010 i C107.02 fr.o.m. de datum som anges i kolumn 0020.<br>e) Maxvärde för dagliga beräkningar av stressjusterat VaR kalibrerat till en enda 12-månadersperiod.<br>f) Maxvärde för veckovisa beräkningar av stressjusterat VaR kalibrerat till en enda 12-månadersperiod,<br>g) Andra val för kalibrering av stressjusterat VaR (specificera).<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att ange startdatum i formatet dd/mm/åååå om alternativ a eller b anges i kolumn 0010 och startdatum i formatet dd/mm/åååå för varje beräkning av stressjusterat VaR om alternativ c eller d anges i kolumn 0010. Institutet ska även använda kolumn 0020 för att förtydliga vilken 12-månadersperiod som används för varje beräkning av stressjusterat VaR om alternativ e, f och g anges i kolumn 0010. |

**C 107.02 – VaR, sVaR och nuvärde (PV) – Icke-KHP. Resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta**

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Portfölj | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Portföljnumret från bilaga V ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Datum | | VaR, SVaR och nuvärde (PV) ska rapporteras för alla 10 bankdagar mellan första RM-referensdagen och sista RM- (och sista ASA)-referensdagen på det sätt som anges i avsnitt 1 b i bilaga V. Formatet ”dd/mm/åå” ska användas för rapportering av datum. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0020 | Value at Risk (VaR) | Artikel 365 i förordning (EU) nr 575/2013 | Ange det 10-dagars föreskrivna VaR som erhålls för varje individuell portfölj utan tillämpning av den ”minst 3” föreskrivna multiplikatorn.<br>Värden ska rapporteras för vart och ett av de datum som anges i kolumn 0010. Fältet ska lämnas tomt om institutet inte beräknar ett VaR på det i kolumn 0010 angivna datumet (dvs. noll-värden ska endast rapporteras om det belopp som följer av beräkningen är noll). |
| 0030 | Stressjusterat VaR (sVar) | Artikel 365 i förordning (EU) nr 575/2013 | Ange det 10-dagars föreskrivna sVaR som erhålls för varje individuell portfölj utan tillämpning av den ”minst 3” föreskrivna multiplikatorn.<br>Värden ska rapporteras för vart och ett av de datum som anges i kolumn 0010. Fältet ska lämnas tomt om institutet inte beräknar ett sVaR på det i kolumn 0010 angivna datumet (dvs. noll-värden ska endast rapporteras om det belopp som följer av beräkningen är noll). |
| 0040 | PV | | Nuvärdet (PV) för varje individuell portfölj ska rapporteras.<br>Värden ska rapporteras för vart och ett av de datum som anges i kolumn 0010. Fältet ska lämnas tomt om institutet inte beräknar ett nuvärde (PV) på det i kolumn 0010 angivna datumet (dvs. noll-värden ska endast rapporteras om det belopp som följer av beräkningen är noll). |

**C 108.00 – Resultat – tidsserier**

Mall C 108.00 (”Resultat - tidsserier”) ska bara fyllas i av institut som beräknar VaR genom historisk simulering.

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Portfölj | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Portföljnumret från bilaga V ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Datum | Artikel 365.1 d i förordning (EU) nr 575/2013 | Instituten ska för varje bankdag enligt kalendern i institutets jurisdiktion ange de resultatserier som använts för att beräkna VaR i C107.02 kolumn 0010 med minst 250 observationer från och med ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet”, på det sätt som anges i avsnitt 1 b v i bilaga V, och bakåt i tiden. |
| 0020 | Dagligt resultat | | Institut som beräknar VaR med hjälp av historisk simulering ska fylla i de fullängdsdataserier som institutet använt, med minst ett års dataserier, med portföljvärdeförändringen (dvs. dagligt resultat) som genereras med hjälp av historiskt simulerade dagliga riskfaktorsförändringar (dvs. dagliga resultatserier som används till att derivera föreskrivet 1-dags-VaR). |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | Om en dag är en helgdag i den berörda jurisdiktionen ska denna cell lämnas tom (dvs. en resultatsiffra på noll ska endast rapporteras om det hypotetiska värdet av en portfölj förblivit oförändrat på den givna bankdagen). |

**C 109.01 – Kapitalkrav för tillkommande fallissemangs- och migrationsrisk (IRC). Uppgifter om modellen**

| Rad | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Antal modelleringsfaktorer | | EBA/GL/2012/3<br>Antalet modelleringsfaktorer i den övergripande IRC-modellen ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) 1 modelleringsfaktor.<br>b) 2 modelleringsfaktorer.<br>c) Fler än 2 modelleringsfaktorer.<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. |
| 0020 | Källa till LGD-värden | | EBA/GL/2012/3<br>Antalet LGD-värden i den övergripande IRC-modellen ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) Marknadskonvention.<br>b) LGD-värden använda i internmetoden (IRB).<br>c) Annan källa till LGD-värden (specificera).<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. Om alternativ c valdes i kolumn 0010 ska institutet ange närmare uppgifter i denna kolumn. |

**C 109.02 – Kapitalkrav för tillkommande fallissemangs- och migrationsrisk (IRC). Uppgifter per portfölj**

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Portfölj | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Portföljnumret från bilaga V, endast för de portföljer där IRC begärs, ska rapporteras. |

| Rad | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Likviditetshorisont | Artikel 374.5 i förordning (EU) nr 575/2013 | EBA/GL/2012/3<br>Likviditetshorisonten som tillämpas på portföljnivån ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) Upp till 3 månader.<br>b) Mer än 3 och upp till 6 månader.<br>c) Mer än 6 och upp till 9 månader.<br>d) Mer än 9 år och upp till 12 månader. |
| 0020 | Källa för PD-värden | | EBA/GL/2012/3<br>Källan för PD-värden som tillämpas på portföljnivå ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) Kreditvärderingsinstitut.<br>b) Internmetoden.<br>c) Marknadsimplicita PD-värden.<br>d) Annan källa till PD-värden (specificera).<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. Om alternativ d valdes i kolumn 0010 ska institutet ange närmare uppgifter i denna kolumn 0020. |
| 0030 | Källa till övergångsmatriser | | EBA/GL/2012/3<br>Källan för de övergångsmatriser som tillämpas på portföljnivå ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) Kreditvärderingsinstitut.<br>b) Internmetoden.<br>c) Marknadsimplicita övergångsmatriser.<br>d) Annan källa till övergångsmatriser (specificera).<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. Om alternativ d valdes i kolumn 0010 ska institutet ange närmare uppgifter i denna kolumn 0020. |

**C 109.03 – Kapitalkrav för tillkommande fallissemangs- och migrationsrisk (IRC). Belopp per portfölj/datum**

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Portfölj | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Portföljnumret från bilaga V, endast för de portföljer där IRC begärs, ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Datum | | IRC ska rapporteras för alla 10 bankdagar mellan första RM-referensdagen och sista RM- (och sista ASA)-referensdagen på det sätt som anges i avsnitt 1 b i bilaga V. Formatet ”dd/mm/åå” ska användas för rapportering av datum. |
| 0020 | IRC | Artiklarna 372–376 i förordning (EU) nr 575/2013 | EBA/GL/2012/3<br>Den föreskrivna IRC som erhålls för respektive portfölj ska rapporteras.<br>Värden ska rapporteras för vart och ett av de datum som anges i kolumn 0010. Fältet ska lämnas tomt om institutet inte beräknar IRC på fastställt datum i kolumn 0010 (dvs. noll-värden ska endast rapporteras om det belopp som följer av beräkningen verkligen är noll). |

**C 110.01 — Korrelationshandel: uppgifter om modellen**

| Rad | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Antal modelleringsfaktorer | Artikel 377 i förordning (EU) nr 575/2013 | Ange antalet modelleringsfaktorer i den övergripande korrelationshandelsmodellen. Ett av följande svar ska anges:<br>a) 1 modelleringsfaktor.<br>b) 2 modelleringsfaktorer.<br>c) Fler än 2 modelleringsfaktorer.<br>Institutet ska använda kolumn 0020 om det vill förtydliga svaret i kolumn 0010. |
| 0020 | Källa till LGD-värden | Artikel 377 i förordning (EU) nr 575/2013 | Ange källan till LGD-värden i den övergripande korrelationshandelsmodellen. Ett av följande svar ska anges:<br>a) Marknadskonvention.<br>b) LGD-värden använda i internmetoden (IRB).<br>c) Annan källa till LGD-värden (specificera).<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. Om alternativ c valdes i kolumn 0010 ska institutet ange närmare uppgifter i denna kolumn. |

**C 110.02 — Korrelationshandel: uppgifter per portfölj**

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Portfölj | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Portföljnumret från bilaga V, endast för de portföljer där APR begärs, ska rapporteras. |

| Rad | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Likviditetshorisont | Artikel 377.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Likviditetshorisonten som tillämpas på portföljnivån ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) Upp till 3 månader.<br>b) Mer än 3 och upp till 6 månader.<br>c) Mer än 6 och upp till 9 månader.<br>d) Mer än 9 år och upp till 12 månader. |
| 0020 | Källa för PD-värden | Artikel 377 i förordning (EU) nr 575/2013 | Källan för PD-värden som tillämpas på portföljnivå ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) Kreditvärderingsinstitut.<br>b) Internmetoden.<br>c) Marknadsimplicita PD-värden.<br>d) Annan källa till PD-värden (specificera).<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. Om alternativ d valdes i kolumn 0010 ska institutet ange närmare uppgifter i denna kolumn 0020. |
| 0030 | Källa till övergångsmatriser | Artikel 377 i förordning (EU) nr 575/2013 | Källan till de övergångsmatriser som tillämpas på portföljnivå ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) Kreditvärderingsinstitut.<br>b) Internmetoden.<br>c) Marknadsimplicita övergångsmatriser.<br>d) Annan källa till övergångsmatriser (specificera).<br>Institutet ska använda kolumn 0020 för att förtydliga svaret i kolumn 0010. Om alternativ d valdes i kolumn 0010 ska institutet ange närmare uppgifter i denna kolumn 0020. |

**C 110.03 – Korrelationshandel: APR per portfölj/datum**

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Portfölj | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Portföljnumret från bilaga V, endast för de portföljer där APR begärs, ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Datum | Artikel 377 i förordning (EU) nr 575/2013 | Alla prisrisker (APR) ska rapporteras för alla tio bankdagar mellan ”första RM-referensdagen” och ”sista RM- (och sista ASA)-referensdagen” på det sätt som avses i avsnitt 1 b i bilaga V. Formatet ”dd/mm/åå” ska användas för rapportering av datum. |
| 0060 | Effektiv ränta | Artikel 377 i förordning (EU) nr 575/2013 | Ange de resultat som erhålls genom tillämpning av den föreskrivna korrelationshandelsmodellen på respektive portfölj.<br>Värden ska rapporteras för vart och ett av de datum som anges i kolumn 0010. Fältet ska lämnas tomt om institutet inte använder en korrelationshandelsmodell på det i kolumn 0010 angivna datumet (dvs. värdet noll ska endast rapporteras om det belopp som följer av beräkningen är noll). |

**C 120.01 – KÄNSLIGHETSBASERAD METOD (SBM). RISKKÄNSLIGHET PER INSTRUMENT/PORTFÖLJ**

Institut ska rapportera, instrument för instrument, känsligheterna för de riskfaktorer som instrumentet är exponerat för. En rad ska rapporteras per riskfaktor/känslighet. Den riskfaktorns nettokurvriskposition (uppåt) (CVRk+) eller den riskfaktorns nettokurvriskposition (nedåt) (CVRk-) på det sätt som anges i artikel 325g i förordning (EU) nr 575/2013 ska rapporteras på separata rader. Alla värden ska hänvisa till ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet” (på det sätt som anges i avsnitt 1 punkt b v i bilaga V till denna förordning). Instituten ska rapportera varje kombination av portfölj, instrumentnummer, (kolumn 0010), riskidentifierare (kolumn 0020) undergrupp (0030) och ytterligare identifierare (kolumn 0040) endast en gång.

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Portfölj | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Numret på portföljen som hämtats från bilaga V ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Instrumentnummer | Avsnitt 2 i bilaga V | Instrumentnumret från bilaga V ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0020 | Riskfaktoridentifierare | Artiklarna 325l, 325m, 325n, 325o, 325p, 325q i förordning (EU) nr 575/2013 | Den riskfaktoridentifierare som anges i tabellen i slutet av denna bilaga ska rapporteras. |
| 0030 | Undergrupp | Artikel 325d.3 i förordning (EU) nr 575/2013 | Undergruppen ska rapporteras när den riskfaktoridentifierare som väljs i kolumn 0020 motsvarar riskklassen:<br>— Generell ränterisk. Svaret ska vara namnet på den relevanta riskfria räntans valuta, inflationen eller valutariskfaktorn (enligt valutabenämningen ISO 4217, t.ex. ”EUR”).<br>— Kreditspreadrisk för icke-värdepapperisering. Svaret ska vara undergruppsnumret i tabell 4 i artikel 325ah.1 i förordning (EU) nr 575/2013.<br>— Kreditspreadrisk för värdepapperisering som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen (icke-ACTP CSR). Svaret ska vara undergruppsnumret i tabell 7 i artikel 325am.1 i den förordningen.<br>— Kreditspreadrisk för värdepapperisering som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen (ACTP CSR). Svaret ska vara undergruppsnumret i tabell 6 i artikel 325ak i den förordningen.<br>— Aktiekursrisk. Svaret ska vara undergruppsnumret i tabell 8 i artikel 325ap.1 i den förordningen.<br>— Råvarurisk. Svaret ska vara undergruppsnumret i tabell 9 i artikel 325as i den förordningen.<br>— FX risk (valutarisk) och komponenterna Delta eller Curvature (kurvrisk). Svaret ska vara valutanamnet (t.ex. ”USD”, rapporteringsvalutans koder ska utformas enligt valutabenämningen ISO 4217).<br>— FX risk (valutarisk) och komponenten Vega. Svaret ska vara valutaparet (t.ex. ”EUR_USD”, rapporteringsvalutans koder ska utformas enligt valutabenämningen ISO 4217). |
| 0040 | Ytterligare identifierare | Artiklarna 325l–325q och 325ai i förordning (EU) nr 575/2013 | Följande uppgifter som urskiljer riskfaktorn på undergruppsnivå ska rapporteras. När den riskfaktoridentifierare som väljs i kolumn 0020 motsvarar riskklassen, gäller följande:<br>— Vid generell ränterisk samt deltakomponenten ska svaret vara namnet på den riskfria kurvan eller någon annan motsvarande unik identifierare.<br>— Vid kreditspreadrisk för icke-värdepapperiseringar eller kreditspreadrisk per riskklass för värdepapperiseringar som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen ska svaret vara utställarens namn eller någon annan motsvarande unik identifierare, och vara identiskt för två rapporterade känsligheter för två riskfaktorer som erhåller korrelationsparametern $\rho_{kl}^{(namn)}$ lika med 1 i enlighet med artikel 325ai.1 i förordning (EU) nr 575/2013.<br>— Vid kreditspreadrisk för värdepapperiseringar eller som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen ska svaret vara tranchbenämningen eller någon annan motsvarande unik identifierare.<br>— Vid aktiekursrisk ska svaret vara utställarens namn eller någon annan motsvarande unik identifierare. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | — Vid råvarurisk ska svaret vara råvarans benämning eller någon annan motsvarande unik identifierare.<br>Om inget av ovanstående fall är tillämpligt, ska institutet rapportera ett uttryckligt värde (NULL) som anger ej tillämpligt. |
| 0060 | Riskkänslighet (resultat uttryckt i rapporteringsvaluta) | Artikel 325d.2 samt artiklarna 325g, 325r, 325s, 325 t och 325ax i förordning (EU) nr 575/2013 | Riskkänsligheter (delta-/vegakänsligheter och kurvriskpositioner) ska rapporteras på respektive instrumentnivå för samtliga relevanta riskfaktorer på det sätt som anges i kolumnerna 0020–0040. Värdena ska rapporteras i institutets rapporteringsvaluta. När den riskfaktoridentifierare som väljs i kolumn 0020 motsvarar följande:<br>— För den känslighetsbaserade metodens deltariskkomponent ska nettokänsligheten för riskfaktorn ($S_k$) på det sätt som anges i artikel 325r i förordning (EU) nr 575/2013 rapporteras. Om instituten har fått tillstånd av sina behöriga myndigheter att använda alternativa beräkningar av deltariskkänsligheter i enlighet med artikel 325t.5 i den förordningen, ska de hänvisa till dessa alternativa definitioner för rapporteringen.<br>— För den känslighetsbaserade metodens vegariskkomponent ska vegariskkänsligheten för en given riskfaktor ($S_k$) på det sätt som anges i artikel 325s i förordning (EU) nr 575/2013 rapporteras. Om instituten har fått tillstånd av sina behöriga myndigheter att använda alternativa beräkningar av vegariskkänsligheter i enlighet med artikel 325t.6 i den förordningen, ska de hänvisa till de alternativa beräkningarna för rapporteringen. Oavsett om beräkningarna i artikel 325s eller en alternativ beräkning i enlighet med artikel 325t.6 i den förordningen används av instituten, ska känsligheten rapporteras efter viktning med den tillhörande implicita volatiliteten.<br>— Den känslighetsbaserade metodens kurvriskkomponent, den riskfaktorns nettokurvriskposition (uppåt) ($CVR_k^+$) eller den riskfaktorns nettokurvriskposition (nedåt) ($CVR_k^-$) på det sätt som anges i artikel 325g i förordning (EU) nr 575/2013 ska rapporteras.<br>Den rapporterade uppgiften ska uttryckas som ett decimaltal med minst två decimalers noggrannhet.<br>Nollvärden ska rapporteras endast om det belopp som följer av beräkningen är noll. |
| 0070 | Rapporteringsvaluta | | Namnet på institutets rapporteringsvaluta ska rapporteras (rapporteringsvalutan ska anges enligt valutaidentifiering ISO 4217, t.ex. ”EUR”). |
| 0080 | Riskkänslighet (resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta) | Avsnitten 3 och 4 i bilaga V till denna förordning ochartikel 325d.2 samt artiklarna 325g, 325r, 325s, 325t och 325ax i förordning (EU) nr 575/2013 | Värdena ska rapporteras enligt anvisningarna för kolumn 0060 men översatta enligt den ECB-avistaväxelkurs som gäller valutan kopplad till det instrumentet på det sätt som anges i avsnitten 3 och 4 i bilaga V till denna förordningen. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0090 | Riskvikt | Del tre avdelning IV kapitel 1a, avsnitt 6 i förordning (EU) nr 575/2013 | Den riskvikt som motsvarar riskfaktorn som anges i kolumnerna 0020 till 0040 ska rapporteras. Om den riskfaktoridentifierare som valts i kolumn 0020 motsvarar kurvriskkomponenten, ska den riskvikt som använts för att bestämma den tillämpliga relativa förskjutningen rapporteras.<br>Den rapporterade uppgiften ska uttryckas som ett decimaltal med minst fyra decimalers noggrannhet. |
| 0110 | Ytterligare identifierare2 | Artikel 325p.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den riskfaktoridentifierare som valts i kolumn 0010 motsvarar riskklassens varurisk och den känslighetsbaserade metodens kurvriskkomponent, ska svaret vara de rättsliga villkoren avseende leveransorten eller en annan motsvarande unik identifierare.<br>Om inget av ovanstående fall är tillämpligt, ska institutet rapportera ett uttryckligt värde (NULL) som anger ej tillämpligt. |
| 0120 | Kreditkvalitetkategori | Artikel 325m.1 och artikel 325ah.1 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den riskfaktoridentifierare som valts i kolumn 0010 motsvarar riskklassens kreditspreadrisk för icke-värdepapperisering och den känslighetsbaserade metodens kurvriskkomponent, ska svaret vara ett av följande:<br>a) ”Kreditkvalitetssteg 1”.<br>b) ”Kreditkvalitetssteg 2”.<br>c) ”Kreditkvalitetssteg 3”.<br>d) ”Kreditkvalitetssteg 4”.<br>e) ”Kreditkvalitetssteg 5”.<br>f) ”Kreditkvalitetssteg 6”.<br>g) ”Inget kreditkvalitetssteg har tilldelats (Utan kreditvärdering)”.<br>Om inget av ovanstående är tillämpligt, ska institutet rapportera ett uttryckligt värde (NULL) som anger ej tillämpligt. |

**C 120.02 – KÄNSLIGHETSBASERAD METOD (SBM). KAPITALBASKRAV (OFR) FÖR TOTAL EXPONERING PER PORTFÖLJ**

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Portfölj | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Numret på portföljen som hämtats från bilaga V ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Riskklass | Artikel 325d.1 i förordning (EU) nr 575/2013 | Exponeringsvärdet ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) ”Generell ränterisk (GIRR)”.<br>b) ”Icke-värdepapperisering” (kreditspreadrisk (CSR) för icke-värdepapperisering).<br>c) ”Kreditspreadrisk. Icke-ACTP CSR” (kreditspreadrisk för värdepapperisering som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen (icke-ACTP CSR).<br>d) ”Kreditspreadrisk. ACTP CSR” (kreditspreadrisk för värdepapperisering som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen (ACTP CSR)).<br>e) ”Aktiekursrisk”.<br>f) ”Råvarurisk”.<br>g) ”Valutarisk”. |
| 0020 | Komponent | Artikel 325e.1 i förordning (EU) nr 575/2013 | Den känslighetsbaserade metodens komponent ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) ”Deltarisk”.<br>b) ”Vegarisk”.<br>c) ”Kurvrisk” (Curvature risk). |
| 0030 | Korrelationsscenario | Artikel 325h i förordning (EU) nr 575/2013 | Korrelationsvärdet ska rapporteras. Ett av följande svar ska anges:<br>a) ”Scenario med medelhög korrelation”<br>b) ”Scenario med hög korrelation”<br>c) ”Scenario med låg korrelation” |
| 0040 | Kapitalbaskrav (resultat uttryckt i rapporteringsvaluta) | Artikel 325h i förordning (EU) nr 575/2013 | Kapitalbaskravvärden ska rapporteras för det ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet” (på det sätt som anges i avsnitt 1 b i bilaga V till denna förordning) för respektive portfölj avseende samtliga relevanta kombinationer av riskklasser, komponenter och korrelationsscenarier. Värdena ska rapporteras i institutets rapporteringsvaluta och uttryckas med minst två decimalers noggrannhet. |
| 0050 | Rapporteringsvaluta | | Institutets rapporteringsvaluta ska rapporteras (rapporteringsvalutan ska anges enligt valutaidentifiering ISO 4217). |
| 0060 | Kapitalbaskrav (resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta) | Avsnitten 3 och 4 i bilaga V till denna förordning och artikel 325h i förordning (EU) nr 575/2013. | Värdena ska rapporteras enligt anvisningarna för kolumn 0040 men översatta enligt den ECB-avistaväxelkurs som gäller valutan kopplad till det instrumentet på det sätt som anges i avsnitten 3 och 4 i bilaga V till denna förordningen. |
| 0070 | Positioner utan optionalitet som omfattas av kapitalbaskrav för kurvrisk | Artikel 325e.3 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om komponenten i kolumn 0020 motsvarar kurvrisk:<br>a) ”JA” ska anges, om institutet tillämpar den metod som anges i artikel 325e.3 första stycket i förordning (EU) nr 575/2013 vid beräkningen av resultaten som rapporteras i kolumnerna 0030 och 0060.<br>b) ”NEJ” ska anges annars.<br>”NEJ” ska också anges om inget av ovanstående fall är tillämpligt. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0080 | Basvalutametoden tillämpad för valutarisk delta och kurvrisk | Artikel 325q.7 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om riskklassen i kolumn 0010 motsvarar valutarisk och komponenten i kolumn 0020 motsvarar deltarisk eller kurvrisk:<br>a) ”JA” ska anges, om institutet tillämpar den metod som anges i artikel 325q.7 i förordning (EU) nr 575/2013 vid beräkningen av resultaten som rapporteras i kolumnerna 0040 och 0060.<br>b) ”NEJ” ska anges annars.<br>”NEJ” ska också anges om inget av ovanstående fall är tillämpligt. |
| 0090 | Division av kurvriskkomponenterna för valutarisken med skalär | Artikel 325q.6 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om riskklassen i kolumn 0010 motsvarar valutarisk och komponenten i kolumn 0020 motsvarar kurvrisk:<br>a) ”JA” ska anges, om institutet tillämpar den metod som anges i artikel 325q.6 i förordning (EU) nr 575/2013 vid beräkningen av resultaten som rapporteras i kolumnerna 0040 och 0060.<br>b) ”NEJ” ska anges annars.<br>”NEJ” ska också anges om inget av ovanstående fall är tillämpligt. |
| 0095 | Inlämnande av resultaten för SBM-valideringsportföljen | Artikel 325e.1 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den portfölj för vilken information rapporteras är en SBM-valideringsportfölj som anges i avsnitt 7 i bilaga V:<br>a) ”Inlämnade” ska anges, om institutet lämnar in resultat som avser denna portfölj.<br>b) ”Ej inlämnade - ingen exponering för riskfaktor” ska anges, om institutet väljer att inte lämna in resultat för den relevanta SBM-valideringsportföljen, eftersom det saknas internt godkännande från institutets ledning om hantering av instrument som skulle ge upphov till exponering för den relevanta riskfaktorn.<br>”Ej tillämpligt” ska anges, om den portfölj för vilken information rapporteras är en portfölj som anges i avsnitt 3, 4 och 5 i bilaga V. |
| 0100 | Fritextfält | | Instituten kan lämna ytterligare information i denna kolumn. |

**C 120.04 – DRC. MARKNADSVÄRDEN OCH BRUTTOBELOPP VID PLÖTSLIGT FALLISSEMANG PER INSTRUMENT/PORTFÖLJ**

Institut ska rapportera, instrument för instrument, de exponeringar som motsvarar instrumentet. En rad ska rapporteras per exponering. Alla värden ska hänvisa till ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet” (på det sätt som anges i avsnitt 1 punkt b v i bilaga V till denna förordning). Exponeringar ska rapporteras före kvittning men efter replikerings- eller uppdelningsstegen (enligt artiklarna 325z och 325zc i förordning (EU) nr 575/2013), i tillämpliga fall.

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Portfölj | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Numret på portföljen som hämtats från bilaga V ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Instrumentnummer | Avsnitt 2 i bilaga V | Instrumentnumret från bilaga V ska rapporteras. |
| 0020 | Riskklass | Artikel 325v.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Riskklassen för vilken fallissemangsriskkravet rapporteras i kolumnerna 0030 och 0040 ska rapporteras. Svaret ska vara ett av följande tre instrumenttyper:<br>a) ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner”.<br>b) ”Värdepapperiseringspositioner som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”.<br>c) ”Värdepapperiseringspositioner som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”. |
| 0030 | Undergrupp1 | Artikel 325y.3, 325aa.4 och 325ad.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Undergruppen ska rapporteras.<br>Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”icke-värdepapperiseringar”, ska svaret vara ett av följande:<br>a) ”Företag”.<br>b) ”Stater”.<br>c) ”Lokala myndigheter/kommuner”.<br>Om i stället den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”värdepapperiseringar som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”, ska svaret vara a ovan eller ett av följande:<br>d) ”Tillgångsbaserade certifikat (ABCP) – Asien”.<br>e) ”Tillgångsbaserade certifikat (ABCP) – Europa”.<br>f) ”Tillgångsbaserade certifikat (ABCP) – Nordamerika”.<br>g) ”Tillgångsbaserade certifikat (ABCP) – övriga världen”.<br>h) ”Billån och billeasingavtal – Asien”.<br>i) ”Billån och billeasingavtal – Europa”.<br>j) ”Billån och billeasingavtal – Nordamerika”.<br>k) ”Billån och billeasingavtal – övriga världen”.<br>l) ”CDO-squared (collateralised debt obligations) – Asien”.<br>m) ”CDO-squared (collateralised debt obligations) – Europa”.<br>n) ”CDO-squared (collateralised debt obligations) – Nordamerika”.<br>o) ”CDO-squared (collateralised debt obligations) – övriga världen”.<br>p) ”CLO (collateralised loan obligations) – Asien”.<br>q) ”CLO (collateralised loan obligations) – Europa”.<br>r) ”CLO (collateralised loan obligations) – Nordamerika”.<br>s) ”CLO (collateralised loan obligations) – övriga världen”.<br>t) ”Värdepapper med lån på kommersiella fastigheter som säkerhet (CMBS) – Asien”.<br>u) ”Värdepapper med lån på kommersiella fastigheter som säkerhet (CMBS) – Europa”.<br>v) ”Värdepapper med lån på kommersiella fastigheter som säkerhet (CMBS) – Nordamerika”.<br>w) ”Värdepapper med lån på kommersiella fastigheter som säkerhet (CMBS) – övriga världen”.<br>x) ”Kreditkort – Asien”.<br>y) ”Kreditkort – Europa”.<br>z) ”Kreditkort – Nordamerika”.<br>aa) ”Kreditkort – övriga världen”.<br>bb) ”Övriga kundkrediter – Asien”.<br>cc) ”Övriga kundkrediter – Europa”.<br>dd) ”Övriga kundkrediter – Nordamerika”. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | ee) ”Övriga kundkrediter – övriga världen”.<br>ff) ”Övrig marknadsupplåning – Asien”.<br>gg) ”Övrig marknadsupplåning – Europa”.<br>hh) ”Övrig marknadsupplåning – Nordamerika”.<br>ii) ”Övrig marknadsupplåning – övriga världen”.<br>jj) ”Värdepapper med privata hypotekslån som säkerhet (RMBS) – Asien”.<br>kk) ”Värdepapper med privata hypotekslån som säkerhet (RMBS) – Europa”.<br>ll) ”Värdepapper med privata hypotekslån som säkerhet (RMBS) – Nordamerika”.<br>mm) ”Värdepapper med privata hypotekslån som säkerhet (RMBS) – övriga världen”.<br>nn) ”Små och medelstora företag – Asien”.<br>oo) ”Små och medelstora företag – Europa”.<br>pp) ”Små och medelstora företag – Nordamerika”.<br>qq) ”Små och medelstora företag – övriga världen”.<br>rr) ”Studielån – Asien”.<br>ss) ”Studielån – Europa”.<br>tt) ”Studielån – Nordamerika”.<br>uu) ”Studielån - övriga världen”.<br>Om i stället den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”värdepapperiseringar som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”, ska svaret vara ”värdepapperiseringar som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”. |
| 0040 | Undergrupp2 | Artikel 325ad.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”värdepapperiseringar som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”, ska svaret vara namnet på indexet, annars ska ”NUL” rapporteras. |
| 0050 | Gäldenär | Artikel 325v.2, artikel 325x.1 samt artiklarna 325z och 325ac i förordning (EU) nr 575/2013 | Institutioner ska lämna information rörande gäldenären. När den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar<br>— ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner”, ska svaret vara namnet på gäldenären,<br>— ”Värdepapperiseringspositioner som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”, ska svaret vara namnet på gäldenären eller en unik identifierare som anger underliggande tillgångspool eller tranche,<br>— ”Värdepapperiseringspositioner som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”, ska svaret vara namnet på gäldenären eller en unik identifierare som anger indexfamilj, serie och tranche. |
| 0060 | Kreditkvalitetkategori | Artikel 325y.1 och 325y.2, artikel 325aa.1 och artikel 325ad.1 i förordning (EU) nr 575/2013 | Instituten ska rapportera kreditkvaliteten. Ett av följande svar ska anges:<br>a) ”Kreditkvalitetssteg 1”.<br>b) ”Kreditkvalitetssteg 2”.<br>c) ”Kreditkvalitetssteg 3”.<br>d) ”Kreditkvalitetssteg 4”.<br>e) ”Kreditkvalitetssteg 5”.<br>f) ”Kreditkvalitetssteg 6”.<br>g) ”Inget kreditkvalitetssteg har tilldelats (Utan kreditvärdering)”. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | h) ”Inget kreditkvalitetssteg har tilldelats (Fallerad)”.<br>i) ”Inget kreditkvalitetssteg har tilldelats (Riskvikt på 0 %)”.<br>Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”värdepapperiseringar som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen” eller ”värdepapperiseringar som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”, ska svaret vara ett av de ovanstående eller följande:<br>j) ”Kreditkvalitetssteg 7”.<br>k) ”Kreditkvalitetssteg 8”.<br>l) ”Kreditkvalitetssteg 9”.<br>m) ”Kreditkvalitetssteg 10”.<br>n) ”Kreditkvalitetssteg 11”.<br>o) ”Kreditkvalitetssteg 12”.<br>p) ”Kreditkvalitetssteg 13”.<br>q) ”Kreditkvalitetssteg 14”.<br>r) ”Kreditkvalitetssteg 15”.<br>s) ”Kreditkvalitetssteg 16”.<br>t) ”Kreditkvalitetssteg 17”.<br>u) ”Kreditkvalitetssteg Alla övriga”. |
| 0070 | Fallissemangsriskvikt | Artikel 325v.1 f, artikel 325y.1 och 325y.2, artikel 325aa.1 och artikel 325ad.1 i förordning (EU) nr 575/2013 | Institut ska rapportera de relevanta riskvikterna. De riskvikter som tillämpas på värdepapperiseringsexponeringar ska rapporteras efter multiplicering med 8 % enligt artikel 325aa.1 i förordning (EU) nr 575/2013. |
| 0080 | Prioritet | Artikel 325w.3 och 325w.6 i förordning (EU) nr 575/2013 | Exponeringens prioritet ska rapporteras. Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner” eller ”värdepapperiseringspositioner som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”, ska svaret vara ett av följande:<br>a) ”Aktieinstrument”.<br>b) ”Lågprioriterade skuldinstrument”.<br>c) ”Prioriterade skuldinstrument”.<br>d) ”Säkerställda obligationer”.<br>Fältet ska lämnas tomt om inget av dessa fall är tillämpligt. |
| 0090 | Löptid | Artiklarna 325x, 325z och 325ac i förordning (EU) nr 575/2013 | Exponeringens förfallodag ska rapporteras. Formatet ”dd/mm/åååå” ska användas för rapportering av datum. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0100 | Återvinningsgrad: | Artikel 325.v1 e i förordning (EU) nr 575/2013 | Instituten ska rapportera återvinningsgraden. Återvinningsgraden ska beräknas med hjälp av den tillämpliga förlusten vid fallissemang (LGD) som återvinningsgrad = 1 – LGD.<br>Den rapporterade uppgiften för återvinningsgraden ska uttryckas som ett decimalvärde mellan 0 och 1, med minst fyra decimalers noggrannhet. |
| 0110 | Riktning | Artikel 325v.1 a och b i förordning (EU) nr 575/2013 | Instituten ska rapportera exponeringens riktning enligt definitionerna i artikel 325v.1 a och b i förordning (EU) nr 575/2013. Ett av följande svar ska anges:<br>a) ”Kort exponering”.<br>b) ”Lång exponering”. |
| 0120 | Attachment point (%) | Artiklarna 325aa, 325ad i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den rapporterade exponeringen hänvisar till en tranche, ska instituten rapportera attachment point för tranchen.<br>Den rapporterade uppgiften ska uttryckas som ett decimaltal med minst fyra decimalers noggrannhet. |
| 0130 | Detachment point (%) | Artiklarna 325aa, 325ad i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den rapporterade exponeringen hänvisar till en tranche, ska instituten rapportera detachment point för tranchen.<br>Den rapporterade uppgiften ska uttryckas som ett decimaltal med minst fyra decimalers noggrannhet. |
| 0140-0170 | Resultat uttryckt i rapporteringsvaluta | | Värdena ska rapporteras med angivande av institutets rapporteringsvaluta och uttryckas med minst fyra decimalers noggrannhet när så är tillämpligt. |
| 0140 | Teoretiskt värde: | Artikel 325w.1, 325w.2 och 325w.5 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner”, ska institut rapportera det teoretiska beloppet för instrumentet. Värdet ska motsvara $V_{notional}$ i artikel 325w.1 och 325w.2 i förordning (EU) nr 575/2013 eller V i artikel 325w.5 i den förordningen, beroende på typen av exponering.<br>Cellen ska lämnas tom om inget av dessa fall är tillämpligt eller om institutet inte explicit beräknar eller använder det belopp som ska beräknas i denna kolumn för att skatta bruttobeloppet vid plötsligt fallissemang (JTD). |
| 0150 | Resultat + justering | Artikel 325w.1, 325w.2 och 325w.5 i förordning (EU) nr 575/2013 | Instituten ska rapportera summan av resultaten och justeringarna för varje exponering:<br>— Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner” och den rapporterade exponeringen är en lång exponering, ska instituten rapportera summan av $P\&L_{lång}$ och $Justering_{lång}$ enligt artikel 325w.1 i förordning (EU) nr 575/2013.<br>— Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner” och den rapporterade exponeringen är en kort exponering, ska instituten rapportera summan av $P\&L_{kort}$ och $Justering_{kort}$ enligt artikel 325w.2 i den förordningen. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | Cellen ska lämnas tom om inget av de ovanstående fallen är tillämpligt eller om institutet inte explicit beräknar eller använder det belopp som ska beräknas i denna kolumn för att skatta bruttobeloppet vid plötsligt fallissemang. |
| 0160 | Bruttobelopp vid plötsligt fallissemang | Artikel 325v.1 c, 325w.1, 325w.2 och 325w.5, artikel 325z.1 och artikel 325ac.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Instituten ska rapportera bruttobelopp vid plötsligt fallissemang (JTD) för den specifika exponeringen. |
| 0170 | Valuta | | Institutets rapporteringsvaluta ska rapporteras (rapporteringsvalutan ska anges enligt valutaidentifiering ISO 4217). |
| 0180-0200 | Resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta | Avsnitten 3 och 4 i bilaga V till denna förordning och artiklarna 325y, 325aa och 325ad i förordning (EU) nr 575/2013 | Värdena ska rapporteras enligt anvisningarna för kolumn 0030 men översatta enligt den ECB-avistaväxelkurs som gäller valutan kopplad till det instrumentet på det sätt som anges i avsnitten 3 och 4 i bilaga V till denna förordningen. |
| 0180 | Teoretiskt värde: | Artikel 325w.1, 325w.2 och 325w.5 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner”, ska institut rapportera det teoretiska beloppet för instrumentet. Värdet ska motsvara $V_{notional}$ i artikel 325w.1 och 325w.2 i förordning (EU) nr 575/2013 eller V i artikel 325w.5 i den förordningen, beroende på typen av exponering.<br>Cellen ska lämnas tom om inget av de ovanstående fallen är tillämpligt eller om institutet inte explicit beräknar eller använder det belopp som ska beräknas i denna kolumn för att skatta bruttobeloppet vid plötsligt fallissemang. |
| 0190 | Resultat + justering | Artikel 325w.1, 325w.2 och 325w.5 i förordning (EU) nr 575/2013 | Instituten ska rapportera summan av resultaten och justeringarna för varje exponering:<br>— Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner” och den rapporterade exponeringen är en lång exponering, ska instituten rapportera summan av $P\&L_{lång}$ and $Justering_{lång}$ enligt artikel 325w.1 i förordning (EU) nr 575/2013.<br>— Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0020 motsvarar ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner” och den rapporterade exponeringen är en kort exponering, ska instituten rapportera summan av $P\&L_{kort}$ and $Justering_{kort}$ enligt artikel 325w.2 i den förordningen. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | Cellen ska lämnas tom om inget av de ovanstående fallen är tillämpligt eller om institutet inte explicit beräknar eller använder det belopp som ska beräknas i denna kolumn för att skatta bruttobeloppet vid plötsligt fallissemang. |
| 0200 | Bruttobelopp vid plötsligt fallissemang | Artikel 325v.1 c, 325w.1, 325w.2 och 325w.5, artikel 325z.1 och artikel 325ac.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Instituten ska rapportera bruttobelopp vid plötsligt fallissemang (JTD) för den specifika exponeringen. |

**C 120.05 – DRC. KAPITALBASKRAV (OFR) FÖR TOTAL EXPONERING PER PORTFÖLJ**

Anvisningar rörande formulär (z-axeln)

| Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|
| Portfölj | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Numret på portföljen som hämtats från bilaga V ska rapporteras. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Riskklass | Artikel 325v.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Riskklassen för vilken fallissemangsriskkravet rapporteras i kolumnerna 0030 och 0040 ska rapporteras. Svaret ska vara ett av följande tre instrumenttyper:<br>a) ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner”.<br>b) ”Värdepapperiseringspositioner som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”.<br>c) ”Värdepapperiseringspositioner som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”. |
| 0020 | Undergrupp1 | Artikel 325y.3, 325aa.4 och 325ad.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Undergruppen ska rapporteras.<br>Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0010 motsvarar ”Andra instrument än värdepapperiseringspositioner”, ska svaret vara ett av följande:<br>a) ”Företag”.<br>b) ”Stater”.<br>c) ”Lokala myndigheter/kommuner”. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | Om i stället den riskklass som rapporteras i kolumn 0010 motsvarar ”värdepapperiseringspositioner som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”, ska svaret vara ett av följande:<br>d) ”Tillgångsbaserade certifikat (ABCP) – Asien”.<br>e) ”Tillgångsbaserade certifikat (ABCP) – Europa”.<br>f) ”Tillgångsbaserade certifikat (ABCP) – Nordamerika”.<br>g) ”Tillgångsbaserade certifikat (ABCP) – övriga världen”.<br>h) ”Billån och billeasingavtal – Asien”.<br>i) ”Billån och billeasingavtal – Europa”.<br>j) ”Billån och billeasingavtal – Nordamerika”.<br>k) ”Billån och billeasingavtal – övriga världen”.<br>l) ”CDO-squared (collateralised debt obligations) – Asien”.<br>m) ”CDO-squared (collateralised debt obligations) – Europa”.<br>n) ”CDO-squared (collateralised debt obligations) – Nordamerika”.<br>o) ”CDO-squared (collateralised debt obligations) – övriga världen”.<br>p) ”CLO (collateralised loan obligations) – Asien”.<br>q) ”CLO (collateralised loan obligations) – Europa”.<br>r) ”CLO (collateralised loan obligations) – Nordamerika”.<br>s) ”CLO (collateralised loan obligations) – övriga världen”.<br>t) ”Värdepapper med lån på kommersiella fastigheter som säkerhet (CMBS) – Asien”.<br>u) ”Värdepapper med lån på kommersiella fastigheter som säkerhet (CMBS) – Europa”.<br>v) ”Värdepapper med lån på kommersiella fastigheter som säkerhet (CMBS) – Nordamerika”.<br>w) ”Värdepapper med lån på kommersiella fastigheter som säkerhet (CMBS) – övriga världen”.<br>x) ”Kreditkort – Asien”.<br>y) ”Kreditkort – Europa”.<br>z) ”Kreditkort – Nordamerika”.<br>aa) ”Kreditkort – övriga världen”.<br>bb) ”Övriga kundkrediter – Asien”.<br>cc) ”Övriga kundkrediter – Europa”.<br>dd) ”Övriga kundkrediter – Nordamerika”.<br>ee) ”Övriga kundkrediter – övriga världen”.<br>ff) ”Övrig marknadsupplåning – Asien”.<br>gg) ”Övrig marknadsupplåning – Europa”.<br>hh) ”Övrig marknadsupplåning – Nordamerika”.<br>ii) ”Övrig marknadsupplåning – övriga världen”.<br>jj) ”Värdepapper med privata hypotekslån som säkerhet (RMBS) – Asien”.<br>kk) ”Värdepapper med privata hypotekslån som säkerhet (RMBS) – Europa”.<br>ll) ”Värdepapper med privata hypotekslån som säkerhet (RMBS) – Nordamerika”.<br>mm) ”Värdepapper med privata hypotekslån som säkerhet (RMBS) – övriga världen”.<br>nn) ”Små och medelstora företag – Asien”.<br>oo) ”Små och medelstora företag – Europa”.<br>pp) ”Små och medelstora företag – Nordamerika”.<br>qq) ”Små och medelstora företag – övriga världen”.<br>rr) ”Studielån – Asien”. |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| | | | ss) ”Studielån – Europa”.<br>tt) ”Studielån – Nordamerika”.<br>uu) ”Studielån – övriga världen”.<br>Om i stället den riskklass som rapporteras i kolumn 0010 motsvarar ”värdepapperiseringspositioner som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”, ska svaret vara ”värdepapperiseringar som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”. |
| 0030 | Undergrupp2 | Artikel 325ad.2 i förordning (EU) nr 575/2013 | Om den riskklass som rapporteras i kolumn 0010 motsvarar ”värdepapperiseringspositioner som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen”, ska svaret vara namnet på indexet, annars ska ”NUL” anges |
| 0040 | Kapitalbaskrav (resultat uttryckt i rapporteringsvaluta) | Artiklarna 325y, 325aa och 325ad i förordning (EU) nr 575/2013 | Alla värden ska hänvisa till ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet” (på det sätt som anges i avsnitt 1 punkt b v i bilaga V till denna förordning). Värdena ska rapporteras i institutets rapporteringsvaluta och uttryckas med minst två decimalers noggrannhet. |
| 0050 | Rapporteringsvaluta | | Institutets rapporteringsvaluta ska rapporteras (rapporteringsvalutan ska anges enligt valutaidentifiering ISO 4217). |
| 0060 | Kapitalbaskrav (resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta) | Avsnitten 3 och 4 i bilaga V till denna förordning och artiklarna 325y, 325aa och 325ad i förordning (EU) nr 575/2013 | Värdena ska rapporteras enligt anvisningarna för kolumn 0030 men översatta enligt den ECB-avistaväxelkurs som gäller valutan kopplad till det instrumentet på det sätt som anges i avsnitten 3 och 4 i bilaga V till denna förordning. |

**C 120.06 — ASA. OFR (kapitalbaskrav)**

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0010 | Portföljnr | Avsnitten 3, 4 och 5 i bilaga V | Numret på portföljen som hämtats från bilaga V ska rapporteras. |
| 0020-0040 | Resultat uttryckt i rapporteringsvaluta | Avsnitten 3 och 4 i bilaga V | |

| Kolumn | Beteckning | Hänvisning | Anvisningar |
|---|---|---|---|
| 0020 | SBM OFR | Artikel 325h i förordning (EU) nr 575/2013 | Kapitalbaskrav för den alternativa schablonmetodens känslighetsbaserade metod ska rapporteras för det ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet” (i enlighet med avsnitt 1 punkt b i bilaga V till denna förordning) för varje portfölj. |
| 0030 | DRC OFR | Artikel 325v i förordning (EU) nr 575/2013 | Kapitalbaskrav för den alternativa schablonmetodens fallissemangsriskkrav ska rapporteras för det ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet” (i enlighet med punkt b avsnitt 1 i bilaga V till denna förordning) för varje portfölj. |
| 0040 | RRAO OFR | Artikel 325u i förordning (EU) nr 575/2013 | Kapitalbaskrav för den alternativa schablonmetodens tillägg för kvarstående risk ska rapporteras för det ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet” (i enlighet med avsnitt 1 punkt b i bilaga V till denna förordning) för varje portfölj. |
| 0050-0070 | Resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta | Avsnitten 3 och 4 i bilaga V | När institutets rapporteringsvaluta skiljer sig från EBA-portföljens valutor som anges i avsnitten 3 och 4 i bilaga V till denna förordning, ska instituten konvertera rapporteringsvalutorna enligt den gällande ECB-avistaväxelkursen. |
| 0050 | SBM OFR | Artikel 325h i förordning (EU) nr 575/2013 | Kapitalbaskrav för den alternativa schablonmetodens känslighetsbaserade metod ska rapporteras för det ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet” (i enlighet med avsnitt 1 punkt b i bilaga V till denna förordning) för varje portfölj. |
| 0060 | DRC OFR | Artikel 325v i förordning (EU) nr 575/2013 | Kapitalbaskrav för den alternativa schablonmetodens fallissemangsriskkrav ska rapporteras för det ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet” (i enlighet med punkt b avsnitt 1 i bilaga V till denna förordning) för varje portfölj. |
| 0070 | RRAO OFR | Artikel 325u i förordning (EU) nr 575/2013 | Kapitalbaskrav för den alternativa schablonmetodens tillägg för kvarstående risk ska rapporteras för det ”sista RM- (och sista ASA-) referensdatumet” (i enlighet med avsnitt 1 punkt b i bilaga V till denna förordning) för varje portfölj. |

**Tabell: Vägledning för rapportering av mallarna 106.01 (kolumn 0010) och 120.01 (kolumn 0020)**

— Kolumnen ”riskklass” hänvisar till artikel 325d.1 i förordning (EU) nr 575/2013. Följande akronymer används för att beteckna de olika riskklasserna:

a) ”GIRR” (generell ränterisk).

b) ”CSR_NON_SEC” (kreditspreadrisk (CSR) för icke-värdepapperisering).

c) ”CSR_SEC_NON_ACTP” (kreditspreadrisk för värdepapperisering som inte ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen (non-ACTP CSR).

d) ”CSR_SEC_ACTP” (kreditspreadrisk för värdepapperisering som ingår i den alternativa korrelationshandelsportföljen (ACTP CSR)).

e) ”EQ” (aktiekursrisk).

f) ”CM” (råvarurisk).

g) ”FX” (valutarisk).

— Kolumnen ”komponent” hänvisar till artikel 325e.1 i förordning (EU) nr 575/2013. Följande akronymer används för att benämna komponenterna i den känslighetsbaserade metoden:

a) ”DELTA” (deltarisk).

b) ”VEGA” (vegarisk).

c) ”CURVATURE” (kurvrisk).

— Kolumnen ”Förfallodag” avser förfallodagen för riskfaktorn, när riskfaktorer definieras utifrån bestämda punkter enligt artiklarna 325l, 325m, 325n, 325o, 325p och 325q i förordning (EU) nr 575/2013. När det gäller vegariskfaktorer för generell ränterisk på det sätt som anges i artikel 325l.7 i den förordningen anges och särskils två förfallodag och löptid med ett bindestreck (t.ex. ”0,5 år - 0,5 år”). Den första uppgiften avser därvid optionens förfallodag och den andra avser den återstående löptiden för optionens underliggande instrument på förfallodagen.

— I kolumnen ”Ytterligare specifikationer” anges vidare respektive riskfaktor avseende distinktionen mellan inflationsrisk och valutariskfaktorer enligt artikel 325l i den förordningen, distinktionen mellan riskfaktorer avseende skuldinstrument och kreditswappar enligt artiklarna 325m och 325n i förordning (EU) nr 575/2013, distinktionen mellan riskfaktorerna avseende aktieavistakurs (Spot price) och aktiereporänta (Repo rate) enligt artikel 325o i den förordningen och distinktionen mellan den riskfaktorns nettokurvriskposition (uppåt) (CVRk+) eller den riskfaktorns nettokurvriskposition (nedåt) (CVRk-) på det sätt som anges i artikel 325g i den förordningen.

| Riskklass | Komponent | Löptid | Ytterligare specifikationer | Riskfaktoridentifierare | Hänvisning |
|---|---|---|---|---|---|
| CM | DELTA | 0 år | | CM_D_00.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | DELTA | 0,25 år | | CM_D_00.25 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | DELTA | 0,5 år | | CM_D_00.50 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | DELTA | 1 år | | CM_D_01.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | DELTA | 2 år | | CM_D_02.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | DELTA | 3 år | | CM_D_03.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | DELTA | 5 år | | CM_D_05.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | DELTA | 10 år | | CM_D_10.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | DELTA | 15 år | | CM_D_15.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | DELTA | 20 år | | CM_D_20.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | DELTA | 30 år | | CM_D_30.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | VEGA | 0,5 år | | CM_V_00.50 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | VEGA | 1 år | | CM_V_01.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | VEGA | 3 år | | CM_V_03.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | VEGA | 5 år | | CM_V_05.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | VEGA | 10 år | | CM_V_10.00 | Artikel 325p i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CM | CURVATURE | | Uppgång i värdet | CM_CU | Artiklarna 325p och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |

| Riskklass | Komponent | Löptid | Ytterligare specifikationer | Riskfaktoridentifierare | Hänvisning |
|---|---|---|---|---|---|
| CM | CURVATURE | | Nedgång i värdet | CM_CD | Artiklarna 325p och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 0,5 år | Skuldinstrument | CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 1 år | Skuldinstrument | CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 3 år | Skuldinstrument | CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 5 år | Skuldinstrument | CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 10 år | Skuldinstrument | CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 0,5 år | Kreditswapp | CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 1 år | Kreditswapp | CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 3 år | Kreditswapp | CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 5 år | Kreditswapp | CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | DELTA | 10 år | Kreditswapp | CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | VEGA | 0,5 år | | CSR_NON_SEC_V_00.50 | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | VEGA | 1 år | | CSR_NON_SEC_V_01.00 | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | VEGA | 3 år | | CSR_NON_SEC_V_03.00 | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | VEGA | 5 år | | CSR_NON_SEC_V_05.00 | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | VEGA | 10 år | | CSR_NON_SEC_V_10.00 | Artikel 325m i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_NON_SEC | CURVATURE | | Uppgång i värdet | CSR_NON_SEC_CU | Artiklarna 325m och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |

| Riskklass | Komponent | Löptid | Ytterligare specifikationer | Riskfaktoridentifierare | Hänvisning |
|---|---|---|---|---|---|
| CSR_NON_SEC | CURVATURE | | Nedgång i värdet | CSR_NON_SEC_CD | Artiklarna 325m och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 0,5 år | Skuldinstrument | CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 1 år | Skuldinstrument | CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 3 år | Skuldinstrument | CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 5 år | Skuldinstrument | CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 10 år | Skuldinstrument | CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 0,5 år | Kreditswapp | CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 1 år | Kreditswapp | CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 3 år | Kreditswapp | CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 5 år | Kreditswapp | CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | DELTA | 10 år | Kreditswapp | CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | VEGA | 0,5 år | | CSR_SEC_ACTP_V_00.50 | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | VEGA | 1 år | | CSR_SEC_ACTP_V_01.00 | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | VEGA | 3 år | | CSR_SEC_ACTP_V_03.00 | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | VEGA | 5 år | | CSR_SEC_ACTP_V_05.00 | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | VEGA | 10 år | | CSR_SEC_ACTP_V_10.00 | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_ACTP | CURVATURE | | Uppgång i värdet | CSR_SEC_ACTP_CU | Artiklarna 325n och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |

| Riskklass | Komponent | Löptid | Ytterligare specifikationer | Riskfaktoridentifierare | Hänvisning |
|---|---|---|---|---|---|
| CSR_SEC_ACTP | CURVATURE | | Nedgång i värdet | CSR_SEC_ACTP_CD | Artiklarna 325n och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | DELTA | 0,5 år | Skuldinstrument | CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_DEBT | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | DELTA | 1 år | Skuldinstrument | CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_DEBT | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | DELTA | 3 år | Skuldinstrument | CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_DEBT | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | DELTA | 5 år | Skuldinstrument | CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_DEBT | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | DELTA | 10 år | Skuldinstrument | CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_DEBT | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | DELTA | 0,5 år | Kreditswapp | CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | DELTA | 1 år | Kreditswapp | CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | DELTA | 3 år | Kreditswapp | CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | DELTA | 5 år | Kreditswapp | CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | DELTA | 10 år | Kreditswapp | CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | VEGA | 0,5 år | | CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50 | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | VEGA | 1 år | | CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00 | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | VEGA | 3 år | | CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00 | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | VEGA | 5 år | | CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00 | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | VEGA | 10 år | | CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00 | Artikel 325n i förordning (EU) nr 575/2013 |
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | CURVATURE | | Uppgång i värdet | CSR_SEC_NON_ACTP_CU | Artiklarna 325n och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |



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

| Riskklass | Komponent | Löptid | Ytterligare specifikationer | Riskfaktoridentifierare | Hänvisning |
|---|---|---|---|---|---|
| CSR_SEC_NO-N_ACTP | CURVATURE | | Nedgång i värdet | CSR_SEC_NON_ACTP_CD | Artiklarna 325n och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |
| EQ | DELTA | | Avistapris (”Spot price”) | EQ_D_SPOT | Artikel 325o i förordning (EU) nr 575/2013 |
| EQ | DELTA | | Reporänta | EQ_D_REPO | Artikel 325o i förordning (EU) nr 575/2013 |
| EQ | VEGA | 0,5 år | | EQ_V_00.50 | Artikel 325o i förordning (EU) nr 575/2013 |
| EQ | VEGA | 1 år | | EQ_V_01.00 | Artikel 325o i förordning (EU) nr 575/2013 |
| EQ | VEGA | 3 år | | EQ_V_03.00 | Artikel 325o i förordning (EU) nr 575/2013 |
| EQ | VEGA | 5 år | | EQ_V_05.00 | Artikel 325o i förordning (EU) nr 575/2013 |
| EQ | VEGA | 10 år | | EQ_V_10.00 | Artikel 325o i förordning (EU) nr 575/2013 |
| EQ | CURVATURE | | Uppgång i värdet | EQ_CU | Artiklarna 325o och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |
| EQ | CURVATURE | | Nedgång i värdet | EQ_CD | Artiklarna 325o och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |
| FX | DELTA | | | FX_D | Artikel 325q i förordning (EU) nr 575/2013 |
| FX | VEGA | 0,5 år | | FX_V_00.50 | Artikel 325q i förordning (EU) nr 575/2013 |
| FX | VEGA | 1 år | | FX_V_01.00 | Artikel 325q i förordning (EU) nr 575/2013 |
| FX | VEGA | 3 år | | FX_V_03.00 | Artikel 325q i förordning (EU) nr 575/2013 |
| FX | VEGA | 5 år | | FX_V_05.00 | Artikel 325q i förordning (EU) nr 575/2013 |
| FX | VEGA | 10 år | | FX_V_10.00 | Artikel 325q i förordning (EU) nr 575/2013 |
| FX | CURVATURE | | Uppgång i värdet | FX_CU | Artiklarna 325q och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |

| Riskklass | Komponent | Löptid | Ytterligare specifikationer | Riskfaktoridentifierare | Hänvisning |
|---|---|---|---|---|---|
| FX | CURVATURE | | Nedgång i värdet | FX_CD | Artiklarna 325q och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 0,25 år | | GIRR_D_00.25 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 0,5 år | | GIRR_D_00.50 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 1 år | | GIRR_D_01.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 2 år | | GIRR_D_02.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 3 år | | GIRR_D_03.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 5 år | | GIRR_D_05.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 10 år | | GIRR_D_10.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 15 år | | GIRR_D_15.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 20 år | | GIRR_D_20.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | 30 år | | GIRR_D_30.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | | Inflation | GIRR_D_INF | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | | Valutabas (mot EUR) | GIRR_D_CRO_EUR | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | DELTA | | Valutabas (mot USD) | GIRR_D_CRO_USD | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 år - 0,5 år | | GIRR_V_00.50_00.50 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 1 år - 0,5 år | | GIRR_V_01.00_00.50 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 år- 0,5 år | | GIRR_V_03.00_00.50 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |

| Riskklass | Komponent | Löptid | Ytterligare specifikationer | Riskfaktoridentifierare | Hänvisning |
|---|---|---|---|---|---|
| GIRR | VEGA | 5 år- 0,5 år | | GIRR_V_05.00_00.50 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 år- 0,5 år | | GIRR_V_10.00_00.50 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 år - 1 år | | GIRR_V_00.50_01.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 1 år - 1 år | | GIRR_V_01.00_01.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 år - 1 år | | GIRR_V_03.00_01.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 år - 1 år | | GIRR_V_05.00_01.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 år - 1 år | | GIRR_V_10.00_01.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 år- 3 år | | GIRR_V_00.50_03.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 1 år - 3 år | | GIRR_V_01.00_03.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 år - 3 år | | GIRR_V_03.00_03.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 år- 3 år | | GIRR_V_05.00_03.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 år- 3 år | | GIRR_V_10.00_03.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 år- 5 år | | GIRR_V_00.50_05.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 1 år - 5 år | | GIRR_V_01.00_05.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 år- 5 år | | GIRR_V_03.00_05.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 år - 5 år | | GIRR_V_05.00_05.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 år- 5 år | | GIRR_V_10.00_05.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |

| Riskklass | Komponent | Löptid | Ytterligare specifikationer | Riskfaktoridentifierare | Hänvisning |
|---|---|---|---|---|---|
| GIRR | VEGA | 0,5 år- 10 år | | GIRR_V_00.50_10.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 1 år - 10 år | | GIRR_V_01.00_10.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 år- 10 år | | GIRR_V_03.00_10.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 år- 10 år | | GIRR_V_05.00_10.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 år - 10 år | | GIRR_V_10.00_10.00 | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 år | Inflation | GIRR_V_00.50_INF | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 1 år | Inflation | GIRR_V_01.00_INF | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 år | Inflation | GIRR_V_03.00_INF | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 år | Inflation | GIRR_V_05.00_INF | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 år | Inflation | GIRR_V_10.00_INF | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 år | Valutabas (mot EUR) | GIRR_V_00.50_CRO_EUR | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 1 år | Valutabas (mot EUR) | GIRR_V_01.00_CRO_EUR | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 3 år | Valutabas (mot EUR) | GIRR_V_03.00_CRO_EUR | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 år | Valutabas (mot EUR) | GIRR_V_05.00_CRO_EUR | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 år | Valutabas (mot EUR) | GIRR_V_10.00_CRO_EUR | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 0,5 år | Valutabas (mot USD) | GIRR_V_00.50_CRO_USD | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 1 år | Valutabas (mot USD) | GIRR_V_01.00_CRO_USD | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |

| Riskklass | Komponent | Löptid | Ytterligare specifikationer | Riskfaktoridentifierare | Hänvisning |
|---|---|---|---|---|---|
| GIRR | VEGA | 3 år | Valutabas (mot USD) | GIRR_V_03.00_CRO_USD | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 5 år | Valutabas (mot USD) | GIRR_V_05.00_CRO_USD | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | VEGA | 10 år | Valutabas (mot USD) | GIRR_V_10.00_CRO_USD | Artikel 325l i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | CURVATURE | | Uppgång i värdet | GIRR_CU | Artiklarna 325l och 325g i förordning (EU) nr 575/2013 |
| GIRR | CURVATURE | | Nedgång i värdet | GIRR_CD | Artiklarna 325l och 325g i förordning (EU) nr 575/2013” |

*BILAGA IV*

*"BILAGA VII*

**Referensportföljer för tillsynsändamål – resultat MARKNADSRISK**

| REFERENSPORTFÖLJER – RESULTAT. MARKNADSRISK | | | |
|---|---|---|---|
| **Mallnummer** | **Mallkod** | **Mallens/mallgruppens namn** | **Förkortning** |
| | | **INITIAL MARKNADSVÄRDERING** | |
| 106,1 | C 106.00 | INITIAL MARKNADSVÄRDERING OCH MOTIVERING TILL UTESLUTNING | IMV |
| 106,2 | C 106.01 | RISKKÄNSLIGHET PER INSTRUMENT | KÄNSLIGHETER |
| | | **VaR, sVaR och PV** | |
| 107,1 | C 107.01 | UPPGIFTER | VaR&SVaR 1 |
| 107,2 | C 107.02 | RESULTAT UTTRYCKT I **EBA-PORTFÖLJENS** VALUTA | VaR&SVaR 2 |
| | | **RESULTAT - TIDSSERIER** | |
| 108 | C 108.00 | RESULTAT - TIDSSERIER | RESULTAT |
| | | **KAPITALKRAV FÖR TILLKOMMANDE FALLISSEMANGS- OCH MIGRATIONSRISK (IRC)** | |
| 109,1 | C 109.01 | IRC. UPPGIFTER OM MODELLEN | IRC 1 |
| 109,2 | C 109.02 | KAPITALKRAV FÖR TILLKOMMANDE FALLISSEMANGS- OCH MIGRATIONSRISK (IRC). UPPGIFTER PER PORTFÖLJ | IRC 2 |
| 109,3 | C 109.03 | KAPITALKRAV FÖR TILLKOMMANDE FALLISSEMANGS- OCH MIGRATIONSRISK (IRC). BELOPP PER PORTFÖLJ/DATUM | IRC 3 |
| | | **KORRELATIONSHANDEL (KH)** | |
| 110,1 | C 110.01 | KH. UPPGIFTER OM MODELLEN | KH 1 |
| 110,2 | C 110.02 | KH. UPPGIFTER PER PORTFÖLJ | KH 2 |
| 110,3 | C 110.03 | KH. BELOPP PER PORTFÖLJ/DATUM | KH 3 |
| | | **ASA (SBM och DRC)** | |
| 120,1 | C 120.01 | SBM. RISKKÄNSLIGHET PER INSTRUMENT/PORTFÖLJ | SBM 1 |
| 120,2 | C 120.02 | SBM. KAPITALBASKRAV (OFR) FÖR TOTAL EXPONERING PER PORTFÖLJ | SBM 2 |
| 120,4 | C 120.04 | DRC. MARKNADSVÄRDEN OCH BRUTTOBELOPP VID PLÖTSLIGT FALLISSEMANG PER INSTRUMENT/PORTFÖLJ | DRC 1 |
| 120,5 | C 120.05 | DRC. KAPITALBASKRAV (OFR) FÖR TOTAL EXPONERING PER PORTFÖLJ | DRC 2 |
| 120,6 | C 120.06 | ASA. KAPITALBASKRAV (OFR) PER PORTFÖLJ | ASA OFR |

## C 106.00 – INITIAL MARKNADSVÄRDERING OCH MOTIVERING TILL UTESLUTNING

| Instrument-nummer | Instrument modellerat för VaR + sVaR (Ja/Nej) | Instrument modellerat för IRC (Ja/Nej) | Instrument modellerat för korrelations-handel (Ja/Nej) | Skäl för uteslutning | Fritextfält | Initial marknads-värdering |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 | 0070 |
| | | | | | | |

## C 106.01 - RISKKÄNSLIGHETER PER INSTRUMENT

**Instrumentnummer**

| Riskfaktoridentifie-rare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Riskkänslighet (resultat uttryckt i rapporteringsvaluta) | Rapporteringsvaluta | Riskkänslighet (resultat uttryckt i EBA-instrumentets valuta) | Prissättningsmodell | Känslighetsdefinition | Fritextfält | Ytterligare identifierare2 | Kreditkvalitetska-tegori |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0050 | 0060 | 0070 | 0080 | 0090 | 0100 | 110 | 120 |
| | | | | | | | | | | |

## C 107.01 - VaR, sVaR och PV. UPPGIFTER

| | | Alternativ | Fritextfält |
|---|---|---|---|
| | | 0010 | 0020 |
| **Value at Risk (VaR)** | | | |
| 0010 | **Metod** | | |
| 0020 | **Beräkning av 10-dagarsperiod** | | |

| | | Alternativ | Fritextfält |
|---|---|---|---|
| | | 0010 | 0020 |
| 0030 | **Observationsperiodens längd** | | |
| 0040 | **Viktning av data** | | |
| 0050 | **Addend enligt utfallstest** | | |
| 0060 | **VaR föreskriven addend** | | |
| **Stressjusterat VaR (SVaR)** | | | |
| 0070 | **Metod** | | |
| 0080 | **Beräkning av 10-dagarsperiod** | | |
| 0090 | **sVaR föreskriven addend** | | |
| 0100 | **SVaR-period** | | |

**C 107.02 - VaR och SVaR Icke-KHP. (RESULTAT UTTRYCKTA I EBA-PORTFÖLJENS VALUTA)**

**Portfölj**

| Datum | Value at Risk (VaR) | Stressjusterat VaR (sVar) | PV |
|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 |
| | | | |





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

**C 108.00- RESULTAT - TIDSSERIER**

**Portfölj**

| Datum | **Dagligt resultat** |
|---|---|
| 0010 | 0020 |
| | |

**C 109.01 – KAPITALKRAV FÖR TILLKOMMANDE FALLISSEMANGS- OCH MIGRATIONSRISK (IRC). UPPGIFTER OM MODELLEN**

| | | **Alternativ** | **Fritextfält** |
|---|---|---|---|
| **Rad** | **Post** | 0010 | 0020 |
| 0010 | **Antal modelleringsfaktorer** | | |
| 0020 | **Källa till LGD-värden** | | |

**C 109.02 – KAPITALKRAV FÖR TILLKOMMANDE FALLISSEMANGS- OCH MIGRATIONSRISK (IRC). UPPGIFTER PER PORTFÖLJ**

**Portfölj**

| | | Alternativ | Fritextfält |
|---|---|---|---|
| **Rad** | **Post** | 0010 | 0020 |
| 0010 | **Likviditetshorisont** | | |
| 0020 | **Källa för PD-värden** | | |
| 0030 | **Källa till övergångsmatriser** | | |

**C 109.03 – KAPITALKRAV FÖR TILLKOMMANDE FALLISSEMANGS- OCH MIGRATIONSRISK (IRC). BELOPP PER PORTFÖLJ/DATUM**

**Portfölj**

| Datum | IRC |
|---|---|
| 0010 | 0020 |
| | |



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

**C 110.01 – KORRELATIONSHANDEL: UPPGIFTER OM MODELLEN**

| | | Alternativ | Fritextfält |
|---|---|---|---|
| **Rad** | **Post** | 0010 | 0020 |
| 0010 | **Antal modelleringsfaktorer** | | |
| 0020 | **Källa till LGD-värden** | | |

**C 110.02 – KORRELATIONSHANDEL: UPPGIFTER PER PORTFÖLJ**

**Portfölj**

| | | Alternativ | Fritextfält |
|---|---|---|---|
| **Rad** | **Post** | 0010 | 0020 |
| 0010 | **Likviditetshorisont** | | |
| 0020 | **Källa för PD-värden** | | |
| 0030 | **Källa till övergångsmatriser** | | |

**C 110.03 – KORRELATIONSHANDEL: EFFEKTIV RÄNTA PER PORTFÖLJ/DATUM**

**Portfölj**

| Datum | **Effektiv ränta** |
|---|---|
| 0010 | 0060 |
| | |

**C 120.01 — KÄNSLIGHETSBASERAD METOD (SBM). RISKKÄNSLIGHET PER INSTRUMENT/PORTFÖLJ**

**Portfölj**

| **Instrumentnummer** | **Riskfaktoridentifierare** | **Undergrupp** | **Ytterligare identifierare** | **Riskkänslighet (resultat uttryckt i rapporteringsvaluta)** | **Rapporteringsvaluta** | **Riskkänslighet (resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta)** | **Riskvikt** | **Ytterligare identifierare2** | **Kreditkvalitetskategori** |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0060 | 0070 | 0080 | 0090 | 110 | 120 |
| | | | | | | | | | |



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

## C 120.02 — KÄNSLIGHETSBASERAD METOD (SBM). KAPITALBASKRAV (OFR) FÖR TOTAL EXPONERING PER PORTFÖLJ

**Portfölj**

| Riskklass | Riskkomponent | Korrelationsscenario | Kapitalbaskrav (resultat uttryckt i rapporteringsvaluta) | Rapporteringsvaluta | Kapitalbaskrav (resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta) | Positioner utan optionalitet som omfattas av kapitalbaskrav för kurvrisk | Basvalutametod som tillämpas för delta- och kurv-valutarisk | Uppdelning av kurvriskkomponenter för valutarisk per skalär | Inlämnande av resultaten för SBM-valideringsportföljen | Fri-textfält |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 | 0070 | 0080 | 0090 | 0950 | 0100 |
| | | | | | | | | | | |

## C 120.04 - DRC. Marknadsvärden och bruttobelopp vid plötsligt fallissemang (JTD) per instrument/portfölj

**Portfölj**

*Heltal*

| Instrumentnummer | Risk-klass | Under-grupp1 | Under-grupp2 | Gäldenär | Kreditkvali-tetskategori | Fallissemangsri-skvikt | Prioritet | Löptid | Återvin-ningsgrad | Riktning | Fästpunkt (%) | Avskiljnings-punkt (%) | Resultat uttryckt i rapporteringsvaluta | | | | Resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | | | | | | | | Teoretiskt värde | Resultat + justering | Bruttobe-lopp vid plötsligt fallisse-mang | Valuta | Teoretiskt värde | Resultat + justering | Bruttobe-lopp vid plötsligt fallisse-mang |
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 | 0070 | 0080 | 0090 | 0100 | 0110 | 0120 | 0130 | 0140 | 0150 | 0160 | 0170 | 0180 | 0190 | 0200 |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

**C 120.05 - DRC. KAPITALBASKRAV (OFR) FÖR TOTAL EXPONERING PER PORTFÖLJ**

**Portfölj**

*Heltal*

| Riskklass | Undergrupp1 | Undergrupp2 | Kapitalbaskrav (resultat uttryckt i rapporteringsvaluta) | Rapporteringsvaluta | Kapitalbaskrav (resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta) |
|---|---|---|---|---|---|
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 |
| | | | | | |

**C 120.06 - DEN ALTERNATIVA SCHABLONMETODEN (ASA). OFR (KAPITALBASKRAV)**

| Portföljnummer | Resultat uttryckt i rapporteringsvaluta | | | Resultat uttryckt i EBA-portföljens valuta | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | SBM OFR | DRC OFR | RRAO OFR | SBM OFR | DRC OFR | RRAO OFR |
| 0010 | 0020 | 0030 | 0040 | 0050 | 0060 | 0070” |
| | | | | | | |



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

*BILAGA V*

*”BILAGA X*

**SBM-valideringsportföljer**

| Databladets namn | Beskrivning |
|---|---|
| Instrument | Instrument (känsligheter och kurvriskpositioner) för SBM-valderingsändamål |
| Portföljer | SBM-valideringsportföljer definierade som kombinationer av de instrument som definieras i denna bilaga |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | UTSTÄLLARE A | | | 100,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQV_aa4# | EQ_V_5.00 | 5 | UTSTÄLLARE AA | | | 1 200,00 |
| S_EQV_ac1# | EQ_V_5.00 | 7 | UTSTÄLLARE AC | | | – 50,00 |
| S_EQV_ae4# | EQ_V_5.00 | 9 | UTSTÄLLARE A | | | 600,00 |
| S_EQV_af4# | EQ_V_5.00 | 10 | UTSTÄLLARE AA | | | 375,00 |
| S_EQV_b4# | EQ_V_5.00 | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 50,00 |
| S_EQV_f4# | EQ_V_5.00 | 5 | UTSTÄLLARE F | | | 450,00 |
| S_EQV_j4# | EQ_V_5.00 | 9 | UTSTÄLLARE J | | | – 200,00 |
| S_EQV_k4# | EQ_V_5.00 | 10 | UTSTÄLLARE K | | | – 825,00 |
| S_EQV_m1# | EQ_V_5.00 | 11 | UTSTÄLLARE 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 | UTSTÄLLARE Y | | | 700,00 |
| S_EQV_a4# | EQ_V_3.00 | 1 | UTSTÄLLARE A | | | – 500,00 |
| S_EQV_aa3# | EQ_V_3.00 | 5 | UTSTÄLLARE AA | | | – 850,00 |
| S_EQV_ad1# | EQ_V_3.00 | 8 | UTSTÄLLARE AD | | | 300,00 |
| S_EQV_ae3# | EQ_V_3.00 | 9 | UTSTÄLLARE AE | | | – 450,00 |
| S_EQV_af3# | EQ_V_3.00 | 10 | UTSTÄLLARE AF | | | – 725,00 |
| S_EQV_b3# | EQ_V_3.00 | 1 | UTSTÄLLARE B | | | – 500,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQV_f3# | EQ_V_3.00 | 5 | UTSTÄLLARE F | | | 250,00 |
| S_EQV_j3# | EQ_V_3.00 | 9 | UTSTÄLLARE J | | | – 900,00 |
| S_EQV_k3# | EQ_V_3.00 | 10 | UTSTÄLLARE 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 | UTSTÄLLARE X | | | – 200,00 |
| S_EQV_z1# | EQ_V_3.00 | 4 | UTSTÄLLARE Z | | | – 800,00 |
| S_EQV_a6# | EQ_V_10.00 | 1 | UTSTÄLLARE A | | | 100,00 |
| S_EQV_aa5# | EQ_V_10.00 | 5 | UTSTÄLLARE AA | | | – 300,00 |
| S_EQV_ab1# | EQ_V_10.00 | 6 | UTSTÄLLARE AB | | | – 400,00 |
| S_EQV_ae5# | EQ_V_10.00 | 9 | UTSTÄLLARE AE | | | – 850,00 |
| S_EQV_af5# | EQ_V_10.00 | 10 | UTSTÄLLARE AF | | | 525,00 |
| S_EQV_b5# | EQ_V_10.00 | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 500,00 |
| S_EQV_f5# | EQ_V_10.00 | 5 | UTSTÄLLARE F | | | 600,00 |
| S_EQV_j5# | EQ_V_10.00 | 9 | UTSTÄLLARE J | | | 150,00 |
| S_EQV_k5# | EQ_V_10.00 | 10 | UTSTÄLLARE 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 | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQV_q1# | EQ_V_10.00 | 13 | INDEX Q | | | – 800,00 |
| S_EQV_a3# | EQ_V_1.00 | 1 | UTSTÄLLARE A | | | 400,00 |
| S_EQV_aa2# | EQ_V_1.00 | 5 | UTSTÄLLARE AA | | | – 400,00 |
| S_EQV_ae2# | EQ_V_1.00 | 9 | UTSTÄLLARE AE | | | – 250,00 |
| S_EQV_af2# | EQ_V_1.00 | 10 | UTSTÄLLARE AF | | | – 1 150,00 |
| S_EQV_b2# | EQ_V_1.00 | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 200,00 |
| S_EQV_f2# | EQ_V_1.00 | 5 | UTSTÄLLARE F | | | – 750,00 |
| S_EQV_j2# | EQ_V_1.00 | 9 | UTSTÄLLARE J | | | 350,00 |
| S_EQV_k2# | EQ_V_1.00 | 10 | UTSTÄLLARE 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 | UTSTÄLLARE A | | | – 100,00 |
| S_EQV_a2# | EQ_V_0.50 | 1 | UTSTÄLLARE A | | | 700,00 |
| S_EQV_aa1# | EQ_V_0.50 | 5 | UTSTÄLLARE AA | | | 950,00 |
| S_EQV_ae1# | EQ_V_0.50 | 9 | UTSTÄLLARE AE | | | 50,00 |
| S_EQV_af1# | EQ_V_0.50 | 10 | UTSTÄLLARE AF | | | – 300,00 |
| S_EQV_b1# | EQ_V_0.50 | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 900,00 |
| S_EQV_c1# | EQ_V_0.50 | 2 | UTSTÄLLARE C | | | – 500,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQV_d1# | EQ_V_0.50 | 3 | UTSTÄLLARE D | | | 600,00 |
| S_EQV_e1# | EQ_V_0.50 | 4 | UTSTÄLLARE E | | | – 800,00 |
| S_EQV_f1# | EQ_V_0.50 | 5 | UTSTÄLLARE F | | | 1 000,00 |
| S_EQV_g1# | EQ_V_0.50 | 6 | UTSTÄLLARE G | | | – 400,00 |
| S_EQV_h1# | EQ_V_0.50 | 7 | UTSTÄLLARE H | | | – 50,00 |
| S_EQV_i1# | EQ_V_0.50 | 8 | UTSTÄLLARE I | | | 300,00 |
| S_EQV_j1# | EQ_V_0.50 | 9 | UTSTÄLLARE J | | | 50,00 |
| S_EQV_k1# | EQ_V_0.50 | 10 | UTSTÄLLARE K | | | – 300,00 |
| S_EQV_l1# | EQ_V_0.50 | 11 | UTSTÄLLARE 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 | UTSTÄLLARE A | | | 16 500,00 |
| S_EQD_a2# | EQ_D_SPOT | 1 | UTSTÄLLARE A | | | – 35 000,00 |
| S_EQD_b1# | EQ_D_SPOT | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 20 000,00 |
| S_EQD_c1# | EQ_D_SPOT | 2 | UTSTÄLLARE C | | | 66 000,00 |
| S_EQD_d1# | EQ_D_SPOT | 3 | UTSTÄLLARE D | | | 1 700,00 |
| S_EQD_e1# | EQ_D_SPOT | 4 | UTSTÄLLARE E | | | 1 100,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQD_f1# | EQ_D_SPOT | 5 | UTSTÄLLARE F | | | 25 000,00 |
| S_EQD_g1# | EQ_D_SPOT | 5 | UTSTÄLLARE G | | | 8 400,00 |
| S_EQD_h1# | EQ_D_SPOT | 6 | UTSTÄLLARE H | | | 22 500,00 |
| S_EQD_i1# | EQ_D_SPOT | 7 | UTSTÄLLARE I | | | – 12 300,00 |
| S_EQD_j1# | EQ_D_SPOT | 8 | UTSTÄLLARE J | | | – 450,00 |
| S_EQD_k1# | EQ_D_SPOT | 9 | UTSTÄLLARE K | | | – 143,00 |
| S_EQD_l1# | EQ_D_SPOT | 9 | UTSTÄLLARE L | | | – 143,00 |
| S_EQD_m1# | EQ_D_SPOT | 10 | UTSTÄLLARE M | | | – 100,00 |
| S_EQD_n1# | EQ_D_SPOT | 10 | UTSTÄLLARE N | | | – 100,00 |
| S_EQD_o1# | EQ_D_SPOT | 11 | UTSTÄLLARE 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 | UTSTÄLLARE U | | | – 57,00 |
| S_EQD_v1# | EQ_D_SPOT | 10 | UTSTÄLLARE V | | | – 100,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQD_a3# | EQ_D_REPO | 1 | UTSTÄLLARE A | | | 50 000,00 |
| S_EQD_aa1# | EQ_D_REPO | 6 | UTSTÄLLARE AA | | | 79 000,00 |
| S_EQD_ab1# | EQ_D_REPO | 7 | UTSTÄLLARE AB | | | 31 000,00 |
| S_EQD_ac1# | EQ_D_REPO | 8 | UTSTÄLLARE AC | | | – 10 000,00 |
| S_EQD_b2# | EQ_D_REPO | 1 | UTSTÄLLARE B | | | – 39 000,00 |
| S_EQD_f2# | EQ_D_REPO | 5 | UTSTÄLLARE F | | | 90 000,00 |
| S_EQD_g2# | EQ_D_REPO | 5 | UTSTÄLLARE G | | | 60 000,00 |
| S_EQD_k2# | EQ_D_REPO | 9 | UTSTÄLLARE K | | | – 14 250,00 |
| S_EQD_l2# | EQ_D_REPO | 9 | UTSTÄLLARE L | | | – 150 000,00 |
| S_EQD_m2# | EQ_D_REPO | 10 | UTSTÄLLARE M | | | – 85 000,00 |
| S_EQD_n2# | EQ_D_REPO | 10 | UTSTÄLLARE N | | | – 72 000,00 |
| S_EQD_p1# | EQ_D_REPO | 11 | UTSTÄLLARE 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 | UTSTÄLLARE X | | | 75 000,00 |
| S_EQD_y1# | EQ_D_REPO | 3 | UTSTÄLLARE Y | | | 4 800,00 |



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

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

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

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

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_EQC_t1# | EQ_CD | 12 | UTSTÄLLARE T | | | – 7 400,00 |
| S_EQC_u1# | EQ_CD | 13 | UTSTÄLLARE U | | | – 11 040,00 |
| S_EQC_v1# | EQ_CD | 12 | UTSTÄLLARE V | | | 38 850,00 |
| S_EQC_w1# | EQ_CD | 13 | UTSTÄLLARE W | | | 57 960,00 |
| S_EQC_y1# | EQ_CD | 1 | UTSTÄLLARE Y | | | 13 590,00 |
| S_EQC_z1# | EQ_CD | 1 | UTSTÄLLARE Z | | | 27 180,00 |
| S_CNV_a5# | CSR_NON_SEC_V_5.00 | 1 | UTSTÄLLARE A | | | 100,00 |
| S_CNV_b4# | CSR_NON_SEC_V_5.00 | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 50,00 |
| S_CNV_c4# | CSR_NON_SEC_V_5.00 | 3 | UTSTÄLLARE C | | | 150,00 |
| S_CNV_hb1# | CSR_NON_SEC_V_5.00 | 9 | UTSTÄLLARE HA | | | – 750,00 |
| S_CNV_a4# | CSR_NON_SEC_V_3.00 | 1 | UTSTÄLLARE A | | | – 500,00 |
| S_CNV_ab1# | CSR_NON_SEC_V_3.00 | 2 | UTSTÄLLARE AB | | | 325,00 |
| S_CNV_b3# | CSR_NON_SEC_V_3.00 | 1 | UTSTÄLLARE B | | | – 500,00 |
| S_CNV_c3# | CSR_NON_SEC_V_3.00 | 3 | UTSTÄLLARE 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 | UTSTÄLLARE A | | | 100,00 |
| S_CNV_b5# | CSR_NON_SEC_V_10.00 | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 500,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CNV_c5# | CSR_NON_SEC_V_10.00 | 3 | UTSTÄLLARE C | | | – 200,00 |
| S_CNV_a3# | CSR_NON_SEC_V_1.00 | 1 | UTSTÄLLARE A | | | 400,00 |
| S_CNV_b2# | CSR_NON_SEC_V_1.00 | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 200,00 |
| S_CNV_c2# | CSR_NON_SEC_V_1.00 | 3 | UTSTÄLLARE C | | | 400,00 |
| S_CNV_a1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 1 | UTSTÄLLARE A | | | – 100,00 |
| S_CNV_a2# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 1 | UTSTÄLLARE A | | | 700,00 |
| S_CNV_b1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 900,00 |
| S_CNV_c1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 3 | UTSTÄLLARE C | | | – 500,00 |
| S_CNV_d1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 4 | UTSTÄLLARE D | | | 700,00 |
| S_CNV_e1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 5 | UTSTÄLLARE E | | | – 800,00 |
| S_CNV_f1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 6 | UTSTÄLLARE F | | | 700,00 |
| S_CNV_g1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 7 | UTSTÄLLARE G | | | – 400,00 |
| S_CNV_h1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 8 | UTSTÄLLARE H | | | – 50,00 |
| S_CNV_i1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 10 | UTSTÄLLARE I | | | 300,00 |
| S_CNV_j1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 11 | UTSTÄLLARE J | | | 50,00 |
| S_CNV_k1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 12 | UTSTÄLLARE K | | | – 300,00 |
| S_CNV_l1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 13 | UTSTÄLLARE L | | | 1 000,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CNV_m1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 14 | UTSTÄLLARE M | | | – 350,00 |
| S_CNV_n1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 15 | UTSTÄLLARE N | | | 950,00 |
| S_CNV_o1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 16 | UTSTÄLLARE O | | | – 900,00 |
| S_CNV_p1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 17 | UTSTÄLLARE P | | | 200,00 |
| S_CNV_q1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 18 | UTSTÄLLARE Q | | | 400,00 |
| S_CNV_r1# | CSR_NON_SEC_V_0.50 | 18 | UTSTÄLLARE 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 | UTSTÄLLARE HB | | | – 17 000,00 |
| S_CND_t1# | CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT | 3 | UTSTÄLLARE 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 | UTSTÄLLARE AC | | | 14 000,00 |
| S_CND_b2# | CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS | 1 | UTSTÄLLARE B | | | – 17 000,00 |
| S_CND_w1# | CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT | 10 | UTSTÄLLARE W | | Kreditkvalitetssteg 1 | 9 000,00 |
| S_CND_a4# | CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT | 1 | UTSTÄLLARE A | | | – 10 000,00 |
| S_CND_s1# | CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT | 3 | UTSTÄLLARE S | | | – 6 000,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | UTSTÄLLARE A | | | 20 000,00 |
| S_CND_a2# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 1 | UTSTÄLLARE A | | | – 30 000,00 |
| S_CND_b1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 12 000,00 |
| S_CND_c1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 3 | UTSTÄLLARE C | | | – 6 000,00 |
| S_CND_d1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 4 | UTSTÄLLARE D | | | 25 000,00 |
| S_CND_e1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 5 | UTSTÄLLARE E | | | – 4 000,00 |
| S_CND_f1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 6 | UTSTÄLLARE F | | | – 8 000,00 |
| S_CND_g1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 7 | UTSTÄLLARE G | | | 8 000,00 |
| S_CND_h1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 8 | UTSTÄLLARE H | | | 3 000,00 |
| S_CND_hb1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 9 | UTSTÄLLARE HA | | | – 23 000,00 |
| S_CND_i1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 10 | UTSTÄLLARE I | | Kreditkvalitetssteg 2 | – 5 000,00 |
| S_CND_j1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 11 | UTSTÄLLARE J | | | 2 000,00 |
| S_CND_k1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 12 | UTSTÄLLARE K | | | 7 000,00 |
| S_CND_l1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 13 | UTSTÄLLARE L | | | – 9 000,00 |
| S_CND_m1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 14 | UTSTÄLLARE M | | | 10 000,00 |
| S_CND_n1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 15 | UTSTÄLLARE N | | | – 20 000,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CND_o1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 16 | UTSTÄLLARE O | | | 5 000,00 |
| S_CND_p1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 17 | UTSTÄLLARE P | | | – 3 000,00 |
| S_CND_q1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 18 | UTSTÄLLARE Q | | | 10 000,00 |
| S_CND_r1# | CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT | 18 | UTSTÄLLARE R | | | – 5 000,00 |
| S_CND_a3# | CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS | 1 | UTSTÄLLARE A | | | 15 000,00 |
| S_CND_ab1# | CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS | 2 | UTSTÄLLARE 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 | UTSTÄLLARE A | | | – 2 338,64 |
| S_CNC_a2# | CSR_NON_SEC_CU | 1 | UTSTÄLLARE A | | | 35 116,67 |
| S_CNC_aa1# | CSR_NON_SEC_CU | 10 | UTSTÄLLARE AA | | Kreditkvalitetssteg 1 | – 1 212,50 |
| S_CNC_ab1# | CSR_NON_SEC_CU | 2 | UTSTÄLLARE AB1 | | | – 247,47 |
| S_CNC_b1# | CSR_NON_SEC_CU | 1 | UTSTÄLLARE B | | | 890,91 |
| S_CNC_c1# | CSR_NON_SEC_CU | 3 | UTSTÄLLARE C | | | – 500,00 |
| S_CNC_d1# | CSR_NON_SEC_CU | 4 | UTSTÄLLARE D | | | 415,00 |
| S_CNC_e1# | CSR_NON_SEC_CU | 5 | UTSTÄLLARE E | | | – 1 050,00 |

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

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

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

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMV_b4# | CM_V_5.00 | 1 | URAN | | | 450,00 |
| S_CMV_a4# | CM_V_3.00 | 1 | KOL | | | 800,00 |
| S_CMV_b3# | CM_V_3.00 | 1 | URAN | | | 800,00 |
| S_CMV_a6# | CM_V_10.00 | 1 | KOL | | | 100,00 |
| S_CMV_b5# | CM_V_10.00 | 1 | URAN | | | – 250,00 |
| S_CMV_a3# | CM_V_1.00 | 1 | KOL | | | – 200,00 |
| S_CMV_b2# | CM_V_1.00 | 1 | URAN | | | – 750,00 |
| S_CMV_d1# | CM_V_1.00 | 2 | WTI | | | – 175,00 |
| S_CMV_f1# | CM_V_1.00 | 3 | FWD ELEKTRICITET NE | | | – 450,00 |
| S_CMV_h1# | CM_V_1.00 | 4 | PANAMAX | | | – 5 500,00 |
| S_CMV_j1# | CM_V_1.00 | 5 | KOPPAR | | | – 200,00 |
| S_CMV_l1# | CM_V_1.00 | 6 | FLYTANDE NATURGAS | | | 1 000,00 |
| S_CMV_n1# | CM_V_1.00 | 7 | SILVER | | | 500,00 |
| S_CMV_p1# | CM_V_1.00 | 8 | MAJS | | | – 1 000,00 |
| S_CMV_r1# | CM_V_1.00 | 9 | VASSLE | | | – 125,00 |
| S_CMV_t1# | CM_V_1.00 | 10 | GUMMI | | | – 50,00 |
| S_CMV_v1# | CM_V_1.00 | 11 | KALIUMKLORID | | | – 1 800,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMV_a1# | CM_V_0.50 | 1 | KOL | | | 1 000,00 |
| S_CMV_a2# | CM_V_0.50 | 1 | KOL | | | – 350,00 |
| S_CMV_b1# | CM_V_0.50 | 1 | URAN | | | 150,00 |
| S_CMV_c1# | CM_V_0.50 | 2 | BRENT | | | 200,00 |
| S_CMV_e1# | CM_V_0.50 | 3 | SPOT ELEKTRICITET SE | | | – 300,00 |
| S_CMV_g1# | CM_V_0.50 | 4 | SUPRAMAX | | | – 5 000,00 |
| S_CMV_i1# | CM_V_0.50 | 5 | STÅL | | | 550,00 |
| S_CMV_k1# | CM_V_0.50 | 6 | NATURGAS | | | 400,00 |
| S_CMV_m1# | CM_V_0.50 | 7 | GULD | | | – 200,00 |
| S_CMV_o1# | CM_V_0.50 | 8 | SOJABÖNOR | | | – 750,00 |
| S_CMV_q1# | CM_V_0.50 | 9 | FISK | | | 250,00 |
| S_CMV_s1# | CM_V_0.50 | 10 | KAKAO | | | 350,00 |
| S_CMV_u1# | CM_V_0.50 | 11 | PLANGLAS | | | 3 000,00 |
| S_CMV_w1# | CM_V_0.50 | 4 | SUPRAMAX | | | – 5 000,00 |
| S_CMV_x1# | CM_V_0.50 | 4 | PANAMAX | | | 15 000,00 |
| S_CMD_p1# | CM_D_30.00 | 8 | MAJS | OKLAHOMA | | – 10 000,00 |
| S_CMD_f1# | CM_D_3.00 | 3 | FWD ELEKTRICITET NE | TEXAS | | – 4 500,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | VASSLE | 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 | FLYTANDE NATURGAS | OKLAHOMA | | 10 000,00 |
| S_CMD_t1# | CM_D_15.00 | 10 | GUMMI | NEWCASTLE | | – 500,00 |
| S_CMD_j1# | CM_D_10.00 | 5 | KOPPAR | OKLAHOMA | | – 2 000,00 |
| S_CMD_v1# | CM_D_10.00 | 11 | KALIUMKLORID | NEWCASTLE | | – 18 000,00 |
| S_CMD_b1# | CM_D_1.00 | 1 | URAN | OKLAHOMA | | 1 500,00 |
| S_CMD_g1# | CM_D_1.00 | 4 | SUPRAMAX | SANTOS | | – 62 500,00 |
| S_CMD_w1# | CM_D_1.00 | 4 | SUPRAMAX | SANTOS | | – 62 500,00 |
| S_CMD_x1# | CM_D_1.00 | 4 | PANAMAX | NEW ORLEANS | | 187 500,00 |
| S_CMD_a4# | CM_D_0.50 | 1 | KOL | NEWCASTLE | | 8 000,00 |
| S_CMD_a1# | CM_D_0.00 | 1 | KOL | NEWCASTLE | | 10 000,00 |
| S_CMD_a2# | CM_D_0.00 | 1 | KOL | NEWCASTLE | | – 3 500,00 |
| S_CMD_a3# | CM_D_0.00 | 1 | KOL | 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 | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMD_e1# | CM_D_0.00 | 3 | SPOT ELEKTRICITET SE | LONDON | | – 3 000,00 |
| S_CMD_i1# | CM_D_0.00 | 5 | STÅL | LE HAVRE | | 5 500,00 |
| S_CMD_k1# | CM_D_0.00 | 6 | NATURGAS | LE HAVRE | | 4 000,00 |
| S_CMD_m1# | CM_D_0.00 | 7 | GULD | UK1 | | – 2 000,00 |
| S_CMD_o1# | CM_D_0.00 | 8 | SOJABÖNOR | LE HAVRE | | – 7 500,00 |
| S_CMD_q1# | CM_D_0.00 | 9 | FISK | LONDON | | 2 500,00 |
| S_CMD_s1# | CM_D_0.00 | 10 | KAKAO | LONDON | | 3 500,00 |
| S_CMD_u1# | CM_D_0.00 | 11 | PLANGLAS | LONDON | | 30 000,00 |
| S_CMC_a1# | CM_CU | 1 | KOL | | | 17 335,00 |
| S_CMC_a2# | CM_CU | 1 | KOL | | | 36 936,00 |
| S_CMC_b1# | CM_CU | 1 | URAN | | | 6 635,00 |
| S_CMC_c1# | CM_CU | 2 | BRENT | | | – 11 600,00 |
| S_CMC_d1# | CM_CU | 2 | WTI | | | – 36 900,00 |
| S_CMC_e1# | CM_CU | 3 | SPOT ELEKTRICITET SE | | | 8 563,00 |
| S_CMC_f1# | CM_CU | 3 | FWD ELEKTRICITET 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 | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMC_i1# | CM_CU | 5 | STÅL | | | – 5 850,00 |
| S_CMC_j1# | CM_CU | 5 | KOPPAR | | | 14 644,80 |
| S_CMC_k1# | CM_CU | 6 | NATURGAS | | | – 6 147,50 |
| S_CMC_l1# | CM_CU | 6 | FLYTANDE NATURGAS | | | – 6 147,50 |
| S_CMC_m1# | CM_CU | 7 | GULD | | | – 1 486,67 |
| S_CMC_n1# | CM_CU | 7 | SILVER | | | 743,33 |
| S_CMC_o1# | CM_CU | 8 | SOJABÖNOR | | | – 14 535,00 |
| S_CMC_p1# | CM_CU | 8 | MAJS | | | 20 475,00 |
| S_CMC_q1# | CM_CU | 9 | FISK | | | – 19 900,00 |
| S_CMC_r1# | CM_CU | 9 | VASSLE | | | 3 387,00 |
| S_CMC_s1# | CM_CU | 10 | KAKAO | | | 1 005,00 |
| S_CMC_t1# | CM_CU | 10 | GUMMI | | | 10 892,20 |
| S_CMC_u1# | CM_CU | 11 | PLANGLAS | | | – 13 790,00 |
| S_CMC_v1# | CM_CU | 11 | KALIUMKLORID | | | 20 685,00 |
| S_CMC_x1# | CM_CU | 9 | MJÖLK | | | – 6 300,00 |
| S_CMC_y1# | CM_CU | 1 | URAN | | | – 65 864,00 |
| S_CMC_z1# | CM_CU | 4 | PANAMAX | | | 29 472,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMC_a1# | CM_CD | 1 | KOL | | | – 18 260,00 |
| S_CMC_a2# | CM_CD | 1 | KOL | | | – 37 630,00 |
| S_CMC_b1# | CM_CD | 1 | URAN | | | – 70 460,00 |
| S_CMC_c1# | CM_CD | 2 | BRENT | | | 8 320,00 |
| S_CMC_d1# | CM_CD | 2 | WTI | | | 3 550,00 |
| S_CMC_e1# | CM_CD | 3 | SPOT ELEKTRICITET SE | | | – 8 233,00 |
| S_CMC_f1# | CM_CD | 3 | FWD ELEKTRICITET NE | | | 16 370,00 |
| S_CMC_g1# | CM_CD | 4 | SUPRAMAX | | | 29 110,00 |
| S_CMC_h1# | CM_CD | 4 | PANAMAX | | | – 15 256,00 |
| S_CMC_i1# | CM_CD | 5 | STÅL | | | 4 080,00 |
| S_CMC_j1# | CM_CD | 5 | KOPPAR | | | – 10 219,80 |
| S_CMC_k1# | CM_CD | 6 | NATURGAS | | | 4 222,50 |
| S_CMC_l1# | CM_CD | 6 | FLYTANDE NATURGAS | | | 4 222,50 |
| S_CMC_m1# | CM_CD | 7 | GULD | | | 1 353,33 |
| S_CMC_n1# | CM_CD | 7 | SILVER | | | – 676,67 |
| S_CMC_o1# | CM_CD | 8 | SOJABÖNOR | | | 10 435,00 |
| S_CMC_p1# | CM_CD | 8 | MAJS | | | – 14 735,00 |

| Instrument | Riskfaktoridentifierare | Undergrupp | Ytterligare identifierare | Ytterligare identifierare 2 | Kreditkvalitetskategori | Riskkänslighet |
|---|---|---|---|---|---|---|
| S_CMC_q1# | CM_CD | 9 | FISK | | | 6 700,00 |
| S_CMC_r1# | CM_CD | 9 | VASSLE | | | – 3 012,00 |
| S_CMC_s1# | CM_CD | 10 | KAKAO | | | – 1 415,00 |
| S_CMC_t1# | CM_CD | 10 | GUMMI | | | – 7 817,20 |
| S_CMC_u1# | CM_CD | 11 | PLANGLAS | | | 14 200,00 |
| S_CMC_v1# | CM_CD | 11 | KALIUMKLORID | | | – 21 300,00 |
| S_CMC_x1# | CM_CD | 9 | MJÖLK | | | – 4 700,00 |
| S_CMC_y1# | CM_CD | 1 | URAN | | | – 66 344,00 |
| S_CMC_z1# | CM_CD | 4 | PANAMAX | | | – 22 856,00 |



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

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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 | KURVRISK | S_IRC_b1# |
| G047 | GIRR | KURVRISK | S_IRC_c1# |
| G048 | GIRR | KURVRISK | S_IRC_a1# S_IRC_b1# |
| G049 | GIRR | KURVRISK | S_IRC_d1# |
| G050 | GIRR | KURVRISK | S_IRC_b1# S_IRC_c1# |
| G051 | GIRR | KURVRISK | S_IRC_c1# S_IRC_e1# |
| G052 | GIRR | KURVRISK | S_IRC_d1# S_IRC_e1# |
| G053 | GIRR | KURVRISK | 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| G054 | GIRR | SAMTLIGA | 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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 | KURVRISK | S_EQC_b1# |
| E089 | EQ | KURVRISK | S_EQC_c1# |
| E090 | EQ | KURVRISK | S_EQC_d1# |
| E091 | EQ | KURVRISK | S_EQC_e1# |
| E092 | EQ | KURVRISK | S_EQC_f1# |
| E093 | EQ | KURVRISK | S_EQC_g1# |
| E094 | EQ | KURVRISK | S_EQC_h1# |
| E095 | EQ | KURVRISK | S_EQC_i1# |
| E096 | EQ | KURVRISK | S_EQC_j1# |
| E097 | EQ | KURVRISK | S_EQC_k1# |
| E098 | EQ | KURVRISK | S_EQC_q1# |
| E099 | EQ | KURVRISK | S_EQC_t1# |
| E100 | EQ | KURVRISK | S_EQC_u1# |
| E101 | EQ | KURVRISK | S_EQC_a1# S_EQC_a2# |
| E102 | EQ | KURVRISK | S_EQC_a1# S_EQC_b1# |
| E103 | EQ | KURVRISK | S_EQC_f1# S_EQC_ac1# |
| E104 | EQ | KURVRISK | S_EQC_j1# S_EQC_ag1# |
| E105 | EQ | KURVRISK | S_EQC_k1# S_EQC_ah1# |
| E106 | EQ | KURVRISK | S_EQC_q1# S_EQC_r1# |
| E107 | EQ | KURVRISK | S_EQC_t1# S_EQC_v1# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| E108 | EQ | KURVRISK | S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# |
| E109 | EQ | KURVRISK | S_EQC_s1# |
| E110 | EQ | KURVRISK | 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 | KURVRISK | S_EQC_a2# S_EQC_q1# |
| E112 | EQ | KURVRISK | S_EQC_t1# S_EQC_u1# |
| E113 | EQ | KURVRISK | S_EQC_a2# S_EQC_t1# |
| E114 | EQ | KURVRISK | S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1# |
| E115 | EQ | KURVRISK | S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# |
| E116 | EQ | KURVRISK | 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 | SAMTLIGA | 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| | | | 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| F015 | FX | KURVRISK | S_FXC_b1# |
| F016 | FX | KURVRISK | S_FXC_c1# |
| F017 | FX | KURVRISK | S_FXC_a1# S_FXC_b1# |
| F018 | FX | KURVRISK | S_FXC_d1# |
| F019 | FX | KURVRISK | S_FXC_b1# S_FXC_c1# |
| F020 | FX | KURVRISK | S_FXC_c1# S_FXC_e1# |
| F021 | FX | KURVRISK | S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# |
| F022 | FX | KURVRISK | 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 | SAMTLIGA | 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 | KURVRISK | 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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 | KURVRISK | S_CNC_b1# |
| N066 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_c1# |
| N067 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_d1# |
| N068 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_e1# |
| N069 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_f1# |
| N070 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_g1# |
| N071 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_h1# |
| N072 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_i1# |
| N073 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_aa1# |
| N074 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_j1# |
| N075 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_k1# |
| N076 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_l1# |
| N077 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_m1# |
| N078 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_n1# |
| N079 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_o1# |
| N080 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_p1# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| N081 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_q1# |
| N082 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_t1# |
| N083 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_u1# |
| N084 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_a1# S_CNC_a2# |
| N085 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_a1# S_CNC_b1# |
| N086 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_q1# S_CNC_r1# |
| N087 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_t1# S_CNC_v1# |
| N088 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_u1# S_CNC_w1# |
| N089 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# |
| N090 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_s1# |
| N091 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | 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 | KURVRISK | 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 | KURVRISK | 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 | KURVRISK | 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 | KURVRISK | 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 | KURVRISK | 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 | KURVRISK | 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 | KURVRISK | 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 | KURVRISK | 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 | KURVRISK | S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# |
| N101 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# |
| N102 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| N103 | CSR_NON_SEC | KURVRISK | 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 | SAMTLIGA | 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| N104(CRR2/DA) | CSR_NON_SEC | KURVRISK | S_CNC_ab1# |
| N105(CRR2/DA) | CSR_NON_SEC | KURVRISK | 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| 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 | KURVRISK | S_CMC_b1# |
| C052 | CM | KURVRISK | S_CMC_c1# |
| C053 | CM | KURVRISK | S_CMC_e1# |
| C054 | CM | KURVRISK | S_CMC_g1# |
| C055 | CM | KURVRISK | S_CMC_i1# |
| C056 | CM | KURVRISK | S_CMC_k1# |
| C057 | CM | KURVRISK | S_CMC_m1# |
| C058 | CM | KURVRISK | S_CMC_o1# |
| C059 | CM | KURVRISK | S_CMC_q1# |
| C060 | CM | KURVRISK | S_CMC_s1# |
| C061 | CM | KURVRISK | S_CMC_u1# |
| C062 | CM | KURVRISK | S_CMC_a1# S_CMC_a2# |
| C063 | CM | KURVRISK | S_CMC_a1# S_CMC_b1# |
| C064 | CM | KURVRISK | S_CMC_c1# S_CMC_d1# |
| C065 | CM | KURVRISK | S_CMC_e1# S_CMC_f1# |
| C066 | CM | KURVRISK | S_CMC_g1# S_CMC_h1# |
| C067 | CM | KURVRISK | S_CMC_i1# S_CMC_j1# |
| C068 | CM | KURVRISK | S_CMC_k1# S_CMC_l1# |
| C069 | CM | KURVRISK | S_CMC_m1# S_CMC_n1# |
| C070 | CM | KURVRISK | S_CMC_o1# S_CMC_p1# |
| C071 | CM | KURVRISK | S_CMC_q1# S_CMC_r1# |
| C072 | CM | KURVRISK | S_CMC_s1# S_CMC_t1# |
| C073 | CM | KURVRISK | S_CMC_u1# S_CMC_v1# |
| C074 | CM | KURVRISK | S_CMC_a2# S_CMC_b1# |
| C075 | CM | KURVRISK | S_CMC_g1# S_CMC_z1# |

| Portfölj | Riskklass | Komponent | Instrument |
|---|---|---|---|
| C076 | CM | KURVRISK | 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 | KURVRISK | S_CMC_a2# S_CMC_u1# |
| C078 | CM | KURVRISK | S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1# |
| C079 | CM | KURVRISK | S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1# |
| C080 | CM | KURVRISK | 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 | SAMTLIGA | 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#” |