

Bruxelles, le 3 septembre 2015

Annexe 2 à la circulaire NBB_2015_24

Tableau de rapport 90.30

Champ d'application

La présente circulaire s'applique aux établissements de crédit de droit belge, aux organismes de liquidation et organismes assimilés à des organismes de liquidation belge de droit belge, et aux compagnies financières. Ces destinataires de la présente circulaire sont dénommés ci après « les établissements ».

Les principes énoncés ici ainsi que les critères pour le processus de contrôle et d'évaluation s'appliquent en principe tant sur une base consolidée que sur une base sociale.

90.30 RISQUE DE TAUX D'INTÉRÊT INHÉRENT AU PORTEFEUILLE BANCAIRE

		Sensibilité patrimoniale		Sensibilité des revenus			
		Valeur économique du portefeuille bancaire		Résultat d'intérêt			
		Hors marges commerciales		Effectif	Anticipé		
		OPTIONNEL		12 mois précédents	12 mois à venir	13e à 24e mois à venir	25e à 26e mois à venir
	CODE	060	010	020	030	040	050
1. Hausse parallèle de 300 points de base	100						
2. Hausse parallèle de 200 points de base	200						
3. Hausse parallèle de 100 points de base	300						
4. Pas de modification	400						
5. Baisse parallèle de 100 points de base	500						
6. Baisse parallèle de 200 points de base	600						
7. Baisse parallèle de 300 points de base	700						