

Brussel, 11 december 2018

Bijlage 2 bij de circulaire NBB_2018_32

Rapporteringstabel 90.30

Toepassingsveld

Deze circulaire is van toepassing op de kredietinstellingen naar Belgisch recht, de met vereffeningsinstellingen gelijkgestelde instellingen, en de financiële holdings. Zij worden hierna als “de instellingen” aangeduid.

De hier vermelde beginselen en criteria voor het toezicht- en evaluatieproces gelden in principe zowel op geconsolideerde als op vennootschappelijke basis.

90.30 RENTERISICO IN HET BANKING BOOK

| | | Vermogensgevoeligheid | | Inkomstengevoeligheid | | | | |
|--|-----|--|--|-----------------------|-----|----------|----------------------|-----------------------|
| | | Economische Waarde Banking Book | | Renteresultaat | | | | |
| | | excl Commerciële marges OPTIONEEL | | Effectief | | Verwacht | | |
| | | | | CODE | 060 | 010 | Vorige 12 maanden | Komende 12 maanden |
| | | | | | 020 | 030 | 040 | 050 |
| 1. Parallele rentestijging met 300 basispunten | 100 | | | | | | | |
| 2. Parallele rentestijging met 200 basispunten | 200 | | | | | | | |
| 3. Parallele rentestijging met 100 basispunten | 300 | | | | | | | |
| 4. Geen beweging | 400 | | | | | | | |
| 5. Parallele rentedaling met 100 basispunten | 500 | | | | | | | |
| 6. Parallele rentedaling met 200 basispunten | 600 | | | | | | | |
| 7. Parallele rentedaling met 300 basispunten | 700 | | | | | | | |