

9R2
Banki könyvi kamatlábckockázat – Kamatkockázati eredmények

Nagyságrend: forint

Sorszám	Sorkód	Megnevezés	HUF	EUR	USD	Jelentős deviza 1	Jelentős deviza 2	Jelentős deviza 3	Jelentős deviza 4	Jelentős deviza 5	Jelentős deviza 6
			1	2	3	4	5	6	7	8	9
			a	b	c	d	e	f	g	h	i
001	9R201	Devizanem									
002	9R2011	A banki könyvi becslült gazdasági tőkeértéke az alapforgatókönyvben (amihez viszonyítva a változást számszerűsítik)									
003	9R2012	A becslült nettó kamatbevétel az alapforgatókönyvben (amihez viszonyítva a változást számszerűsítik)									
004	9R2013	A valós értéken értékelt pozíciók értéke az alapforgatókönyvben (amelyhez viszonyítva a változást számszerűsítik)									
005	9R2014	A számviteli fedezeti elszámolásba bevont valós értéken értékelt pozíciók értéke az alapforgatókönyvben (amelyhez viszonyítva a változást számszerűsítik)									
006	9R202	A banki könyv becslült gazdasági értékének változása a hozamgörbe párhuzamos hirtelen 200 bázispontos növekedése esetén (EBA/GL/2018/02 iránymutatás 113. pontja alapján)									
007	9R203	A banki könyv becslült gazdasági értékének változása a hozamgörbe párhuzamos hirtelen 200 bázispontos csökkenése esetén (EBA/GL/2018/02 iránymutatás 113. pontja alapján)									
008	9R204	A banki könyv becslült gazdasági értékének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás 114. pontja alapján számítva az 1. szcenárió (párhuzamos felfelé) bekövetkezése esetén									
009	9R205	A banki könyv becslült gazdasági értékének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás 114. pontja alapján számítva a 2. szcenárió (párhuzamos lefelé) bekövetkezése esetén									
010	9R206	A banki könyv becslült gazdasági értékének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás 114. pontja alapján számítva a 3. szcenárió (meredekebbé válás, rövid hozamok csökkenése, hosszú hozamok emelkedése) bekövetkezése esetén									
011	9R207	A banki könyv becslült gazdasági értékének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás 114. pontja alapján számítva a 4. szcenárió (laposabbá válás, rövid hozamok emelkedése, hosszú hozamok csökkenése) bekövetkezése esetén									
012	9R208	A banki könyv becslült gazdasági értékének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás 114. pontja alapján számítva az 5. szcenárió (rövid hozam emelkedése) bekövetkezése esetén									
013	9R209	A banki könyv becslült gazdasági értékének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás 114. pontja alapján számítva a 6. szcenárió (rövid hozam csökkenése) bekövetkezése esetén									
014	9R210	Nettó kamatbevétel 12 hónapos előrejelzésének változása a hozamgörbe párhuzamos hirtelen 200 bázispontos növekedése esetén									
015	9R211	Nettó kamatbevétel 12 hónapos előrejelzésének változása a hozamgörbe párhuzamos hirtelen 200 bázispontos csökkenése esetén									
016	9R212	Nettó kamatbevétel 12 hónapos előrejelzésének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 1. szcenárió (párhuzamos felfelé) bekövetkezése esetén									
017	9R213	Nettó kamatbevétel 12 hónapos előrejelzésének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 2. szcenárió (párhuzamos lefelé) bekövetkezése esetén									
018	9R214	Nettó kamatbevétel 12 hónapos előrejelzésének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 3. szcenárió (meredekebbé válás, rövid hozamok csökkenése, hosszú hozamok emelkedése) bekövetkezése esetén									
019	9R215	Nettó kamatbevétel 12 hónapos előrejelzésének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 4. szcenárió (laposabbá válás, rövid hozamok emelkedése, hosszú hozamok csökkenése) bekövetkezése esetén									
020	9R216	Nettó kamatbevétel 12 hónapos előrejelzésének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 5. szcenárió (rövid hozam emelkedése) bekövetkezése esetén									
021	9R217	Nettó kamatbevétel 12 hónapos előrejelzésének változása az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 6. szcenárió (rövid hozam csökkenése) bekövetkezése esetén									
022	9R218	A valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 1. szcenárió (párhuzamos felfelé) bekövetkezése esetén									
023	9R219	A számviteli fedezeti elszámolásba bevont valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 1. szcenárió (párhuzamos felfelé) bekövetkezése esetén									
024	9R220	A valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 2. szcenárió (párhuzamos lefelé) bekövetkezése esetén									
025	9R221	A számviteli fedezeti elszámolásba bevont valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 3. szcenárió (meredekebbé válás, rövid hozamok csökkenése, hosszú hozamok emelkedése) bekövetkezése esetén									
026	9R222	A valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 4. szcenárió (laposabbá válás, rövid hozamok emelkedése, hosszú hozamok csökkenése) bekövetkezése esetén									
027	9R223	A számviteli fedezeti elszámolásba bevont valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 5. szcenárió (rövid hozam emelkedése) bekövetkezése esetén									
028	9R224	A valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 6. szcenárió (rövid hozam csökkenése) bekövetkezése esetén									
029	9R225	A számviteli fedezeti elszámolásba bevont valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 1. szcenárió (párhuzamos felfelé) bekövetkezése esetén									
030	9R226	A valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 2. szcenárió (párhuzamos lefelé) bekövetkezése esetén									
031	9R227	A számviteli fedezeti elszámolásba bevont valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 3. szcenárió (meredekebbé válás, rövid hozamok csökkenése, hosszú hozamok emelkedése) bekövetkezése esetén									
032	9R228	A valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 4. szcenárió (laposabbá válás, rövid hozamok emelkedése, hosszú hozamok csökkenése) bekövetkezése esetén									
033	9R229	A számviteli fedezeti elszámolásba bevont valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 5. szcenárió (rövid hozam emelkedése) bekövetkezése esetén									
034	9R230	A valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 6. szcenárió (rövid hozam csökkenése) bekövetkezése esetén									
035	9R231	A számviteli fedezeti elszámolásba bevont valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 1. szcenárió (párhuzamos felfelé) bekövetkezése esetén									
036	9R232	A valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 2. szcenárió (párhuzamos lefelé) bekövetkezése esetén									
037	9R233	A számviteli fedezeti elszámolásba bevont valós értéken értékelt pozíciók értéke az EBA/GL/2018/02 iránymutatás szerinti 3. szcenárió (meredekebbé válás, rövid hozamok csökkenése, hosszú hozamok emelkedése) bekövetkezése esetén									
038	9R234	A gazdasági tőkeérték illetve annak változása számszerűsítéskor a pénzáramlások és a diszkontáláshoz használt kamatláb tartalmaz-e felárakat? (Igen/Nem)									

Jelmagyarázat
Tilos