

20. oktober 2017

Kommentar til redegørelse om påbud til Nykredit Realkredit A/S på markedsrisikoområdet

Som led i det løbende tilsyn har Finanstilsynet gennemført en revurdering af Nykredits tilladelse til at opgøre kapitalkrav for markedsrisiko ved en intern model.

Finanstilsynet finder, at Nykredits model ikke er i overensstemmelse med best practise og ikke er tilstrækkeligt retvisende for Nykredits markedsrisiko. Nykredit får derfor en række påbud, der går dels på selve modellen og dels på governance for modellen.

Kommentar til redegørelsen:

Nykredit noterer sig påbuddene fra Finanstilsynet og tager dem til efterretning. Nykredit er i proces med at udarbejde en ny model til beregning af kapitalkrav for markedsrisiko – en ny model der skal klargøre Nykredit til den kommende regulering inden for markedsrisikoområdet og samtidig imødekommer påbuddene. Indtil den nye model foreligger, vil Nykredit have et forhøjet kapitalkrav på den eksisterende model.