

## ANHANG VI

## ERGEBNISSE DER AUFSICHTLICHEN REFERENZPORTFOLIOS

<b>MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN</b> .....	3127
C 106.00 — Ursprüngliche Marktbewertung und Gründe für die Nichteinbeziehung .....	3127
C 106.01 — SBM. Risikosensitivitäten nach Instrument .....	3128
C 107.01 — VaR und sVaR Nicht-CTP. Nähere Angaben .....	3132
C 107.02 — VaR, sVaR und PV — Nicht-CTP. Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung .....	3135
C 108.00 — Gewinn- und Verlust-Zeitreihen .....	3136
C 109.01 — IRC. Nähere Angaben zum Modell.....	3137
C 109.02 — IRC. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios .....	3138
C 109.03 — IRC. Betrag nach Portfolio/Datum .....	3139
C 110.01 — CT. Nähere Angaben zum Modell .....	3140
C 110.02 — CT. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios .....	3141
C 110.03 — CT. APR nach Portfolio/Datum .....	3142
C 120.01 — SBM. RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO .....	3143
C 120.02 — SBM. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO .....	3147
C 120.04 — DRC. MARKTWERTE UND JUMP-TO-DEFAULT-(JT-)-BRUTTOBETRÄGE NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO .....	3149
C 120.05 — DRC. EIGENMITTELANFORDERUNGS-(OFR)-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO .....	3156
C 120.06 — ASA. OFR .....	3159

**MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN**

**C 106.00 — Ursprüngliche Marktbewertung und Gründe für die Nichteinbeziehung**

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V dieser Verordnung.
0020	Modellierung des Instruments für VaR und sVaR (JA/NEIN)		Bitte entweder JA oder NEIN angeben.
0030	Modellierung des Instruments für IRC (JA/NEIN)		Bitte entweder JA oder NEIN angeben.
0040	Modellierung des Instruments für Korrelationshandel (JA/NEIN)		Bitte entweder JA oder NEIN angeben.
0050	Grund für die Nichteinbeziehung	Artikel 3 Absatz 2 der Durchführungsverordnung (EU) 2016/2070 der Kommission	Auszuwählen ist eine der folgenden Möglichkeiten: a) Modell von der Regulierungsbehörde nicht genehmigt. b) Instrument oder Basiswert intern nicht genehmigt. c) Basiswert oder Modellierungsmerkmal intern nicht vorgesehen d) Anderer Grund für die Nichteinbeziehung. Bitte in Spalte 0060 erläutern.
0060	Freitextfeld		In dieser Spalte kann das Institut zusätzliche Angaben machen.
0070	Ursprüngliche Marktbewertung („IMV“)		Nach der Mark-to-Market-Methode ermittelter Wert jedes einzelnen Instruments um 17:30 Uhr MEZ am Stichtag (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung). Möchte das Institut für ein bestimmtes Portfolio keine IMV bereitstellen, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).

C 106.01 — **SBM. Risikosensitivitäten nach Instrument**

Hier melden die Institute die Sensitivitäten gegenüber den Risikofaktoren, denen das Instrument ausgesetzt ist. Dabei ist ein Risikofaktor/eine Sensitivität pro Zeile anzugeben. Die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition des betreffenden Risikofaktors (CVRk+) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk-) im Sinne von Artikel 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist in eigenen Zeilen zu melden. Alle Werte sind auf das „IMV- (und das erste SBM-)Referenzdatum“ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b Ziffer ii dieser Verordnung) zu beziehen. Die Institute dürfen jede Kombination aus Instrumentennummer, Risikokennung (Spalte 0010), Unterklasse (Spalte 0020) und Zusätzlicher Kennung (Spalte 0030) nur einmal melden.

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V dieser Verordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Risikofaktor-Kennung	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben ist die einschlägige Risikofaktor-Kennung aus der Tabelle am Ende dieses Anhangs.
0020	Unterklasse	Artikel 325d Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Unterklasse auszuweisen, je nachdem, welcher Risikoklasse die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung entspricht: <ul style="list-style-type: none"> <li>— Allgemeines Zinsrisiko — anzugeben ist die Währung des Risikofaktors maßgebliche risikofreie Zinssätze, Inflationsrisiko oder Basis-Währungsrisiko (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ,EUR’).</li> <li>— Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen — anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ah Absatz 1 Tabelle 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013.</li> <li>— Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR Nicht-ACTP) — anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325am Absatz 1 Tabelle 7 der genannten Verordnung.</li> <li>— Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR ACTP) — anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ak Tabelle 6 der genannten Verordnung.</li> <li>— Aktienkursrisiko — anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ap Absatz 1 Tabelle 8 der genannten Verordnung.</li> <li>— Warenpositionsrisiko — anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325as Tabelle 9 der genannten Verordnung.</li> <li>— Fremdwährungsrisiko und Komponenten Delta oder Krümmung — anzugeben ist die Währung (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ,USD’).</li> </ul>

			<p>— Fremdwährungsrisiko und Komponente Vega — anzugeben ist das Währungspaar (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR_USD‘).</p>
0030	Zusätzliche Kennung 1	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Um den Risikofaktor innerhalb der Unterklasse genauer zu kennzeichnen, werden die nachstehend ausgeführten Angaben gemeldet. Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— Allgemeines Zinsrisiko und Delta-Komponente, so ist die Bezeichnung der risikofreien Kurve oder eine andere entsprechende eindeutige Kennung anzugeben;</li> <li>— Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen oder der Risikoklasse Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR ACTP), so ist der Name des Emittenten oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben;</li> <li>— Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR Nicht-ACTP), so ist die Bezeichnung der Tranche oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben;</li> <li>— Aktienkursrisiko, so ist die Aktienemittenten-Adresse oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben;</li> <li>— Warenpositionsrisiko, so ist die Bezeichnung der Ware oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben.</li> </ul> <p>Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist ein Leerwert (NUL) anzugeben.</p>
0050	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325g, 325r, 325s, 325 t und 325ax der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Die Risikosensitivitäten (Delta/Vega-Sensitivitäten und Krümmungsrisikopositionen) sind für alle in den Spalten 0010 bis 0030 genannten relevanten Risikofaktoren auf der Ebene des einzelnen Instruments anzugeben. Für die Angaben dieser Werte ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts zu verwenden. Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Netto-Sensitivität gegenüber dem Risikofaktor (<math>S_k</math>) im Sinne von Artikel 325r der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben; Haben die Institute von ihrer zuständigen Behörde die Erlaubnis erhalten, nach Artikel 325t Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 alternative Begriffsbestimmungen für Delta-Risikosensitivitäten zu verwenden, so beziehen sie sich bei ihrer Meldung auf diese alternativen Definitionen.</li> <li>— der Vega-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Vega-Risikosensitivität einer Option gegenüber einem gegebenen Risikofaktor (<math>S_k</math>) im Sinne von Artikel 325s der genannten Verordnung anzugeben; Haben die Institute von ihrer zuständigen Behörde die Erlaubnis erhalten, nach Artikel 325t Absatz 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 alternative Berechnungen der Vega-Risikosensitivitäten zu verwenden, so beziehen sie sich bei ihrer Meldung auf diese alternativen Berechnungen. Unabhängig davon, ob das Institut die Definition nach Artikel 325s oder eine alternative Kalkulation nach Artikel 325 t Absatz 6 der genannten Verordnung verwendet, ist die Sensitivität nach Gewichtung mit der entsprechenden impliziten Volatilität anzugeben.</li> </ul>

			<p>— der Krümmungsrisikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (<math>CVR_k^+</math>) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (<math>CVR_k^-</math>) im Sinne von Artikel 325g der genannten Verordnung anzugeben.</p> <p>Die gemeldete Zahl ist mit einer Genauigkeit von mindestens zwei Dezimalstellen anzugeben.</p> <p>Nullwerte sind nur dann anzugeben, wenn die Berechnung tatsächlich null ergibt.</p>
0060	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217, z. B. „EUR“).
0070	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung des EBA-Instruments)	Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung und Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325r, 325s sowie 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0050 anzugeben, allerdings umgerechnet zum EZB-Kassakurs für die Währung des Instruments im Sinne von Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung.
0080	Bewertungsmodell	Artikel 325t der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Hier gibt das Institut an, aus welchem Bewertungsmodell die Sensitivitäten abgeleitet werden. Auszuwählen ist eine der folgenden Möglichkeiten:</p> <p>a) „Bewertungsmodelle des Instituts, die als Grundlage für die Meldung von Gewinnen und Verlusten an das höhere Management dienen“ (im Sinne von Artikel 325t Absatz 1 Unterabsatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013);</p> <p>b) „Auf internen Modellen des Instituts basierender Ansatz“ (im Sinne von Artikel 325 t Absatz 1 Unterabsatz 2 der genannten Verordnung).</p>
0090	Definition der Sensitivitäten	Artikel 325r, 325s und 325t der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Das Institut gibt an, welche Definition der Sensitivitäten bei der Berechnung der Eigenmittelanforderungen zugrunde gelegt wird.</p> <p>Auszuwählen ist eine der folgenden Möglichkeiten:</p> <p>a) ‚Definition der Sensitivitäten nach den Artikeln 325r und 325s der Verordnung (EU) Nr. 575/2013‘;</p> <p>b) ‚Definition der Sensitivitäten nach Artikel 325t Absätze 5 und 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013‘.</p> <p>Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktorkennung der Krümmungsrisikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist der unter Buchstabe b genannte Wert auszuweisen, falls eine der bei der Berechnung der gemeldeten Krümmungsrisikoposition verwendeten Sensitivitäten auf einer Sensitivitätsdefinition nach Artikel 325t Absätze 5 und 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 basiert; andernfalls ist der unter Buchstabe a genannte Wert auszuweisen.</p>

0100	Freitextfeld		In dieser Spalte können zusätzliche Angaben zum Bewertungsmodell und zur Definition der Sensitivitäten gemacht werden.
0110	Zusätzliche Kennung 2	Artikel 325p Absatz 2 der Verordnung Nr. 575/2013 (EU)	Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse Warenpositionsrisiko und der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so sind die rechtlichen Bestimmungen in Bezug auf den Lieferort oder eine andere entsprechende eindeutige Kennung anzugeben. Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist ein Leerwert (NUL) anzugeben.
0120	Bonitätskategorie	Artikel 325m Absatz 1 und Artikel 325ah Absatz 1 der Verordnung Nr. 575/2013 (EU)	Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen und der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: a) ‚Bonitätsstufe 1‘; b) ‚Bonitätsstufe 2‘; c) ‚Bonitätsstufe 3‘; d) ‚Bonitätsstufe 4‘; e) ‚Bonitätsstufe 5‘; f) ‚Bonitätsstufe 6‘; g) ‚Keine Bonitätsstufe (unbeurteilt)‘. Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist ein Leerwert (NUL) anzugeben.

## C107.01 — VaR und sVaR Nicht-CTP. Nähere Angaben

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010-00-60	VaR		
0010	Methodik		<p>In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) Historische Simulation;</li> <li>b) Monte-Carlo-Simulation;</li> <li>c) Parametrisch;</li> <li>d) Kombination/Sonstige (bitte angeben).</li> </ul> <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.</p>
0020	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen	Artikel 365 Absatz 1 der Verordnung Nr. 575/2013 (EU)	<p>In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) 1 Tag aufskaliert auf 10 Tage;</li> <li>b) 10 Tage ohne Überlappungsperioden;</li> <li>c) 10 Tage, sonstige Methodik.</li> </ul> <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.</p>
0030	Länge des Beobachtungszeitraums	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) bis zu 1 Jahr;</li> <li>b) mehr als 1 Jahr, bis zu 2 Jahre;</li> <li>c) mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahre;</li> <li>d) mehr als 3 Jahre.</li> </ul> <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.</p>
0040	Datengewichtung	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) Ungewichtet (VaR-Datengewichtung);</li> <li>b) Gewichtet (VaR-Datengewichtung);</li> <li>c) Jeweils höherer Wert von ‚Ungewichtet‘ unter a und ‚Gewichtet‘ unter b (VaR-Datengewichtung).</li> </ul> <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.</p>

0050	Backtesting-Zuschlagsfaktor	Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Der Backtesting-Zuschlagsfaktor ist der Zuschlagsfaktor zwischen 0 und 1 aus Artikel 366 Absatz 2 Tabelle 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0060	Aufsichtlicher VaR-Zuschlagsfaktor	Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 („mindestens 3“)	Der aufsichtliche VaR-Zuschlagsfaktor ist der von der zuständigen Behörde vorgegebene Zuschlagsfaktor auf den VaR-Multiplikationsfaktor (mindestens 3) nach Maßgabe von Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Der aufsichtliche VaR-Zuschlagsfaktor entspricht der Summe aus dem Backtesting-Zuschlagsfaktor und, falls anwendbar, dem qualitativen Zuschlagsfaktor über 3 hinaus. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0070-01-00	sVaR (d. h. VaR unter Stressbedingungen)		
0070	Methodik		In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) Historische Simulation; b) Monte-Carlo-Simulation; c) Parametrisch; d) Kombination/Sonstige (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.
0080	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen	Artikel 365 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) 1 Tag aufskaliert auf 10 Tage; b) 10 Tage ohne Überlappungsperioden; c) 10 Tage, sonstige Methodik. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0090	Aufsichtlicher sVaR-Zuschlagsfaktor	Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Der aufsichtliche Zuschlagsfaktor ist der von der zuständigen Behörde vorgegebene Zuschlagsfaktor auf den sVaR-Multiplikationsfaktor (mindestens 3) nach Maßgabe von Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Der aufsichtliche Zuschlagsfaktor entspricht der Summe aus 3, dem Backtesting-Zuschlagsfaktor und dem qualitativen Zuschlagsfaktor (falls anwendbar). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.

0100	sVaR-Zeitraum	Artikel 365 Absatz 2 der Verordnung Nr. 575/2013 (EU)	<p>In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) tägliche Berechnung von sVaR, kalibriert auf einen ununterbrochenen 12-Monats-Zeitraum, beginnend mit dem in Spalte 0020 angegebenen Datum;</li> <li>b) wöchentliche Berechnung von sVaR, kalibriert auf einen ununterbrochenen 12-Monats-Zeitraum, beginnend mit dem in Spalte 0020 angegebenen Datum;</li> <li>c) tägliche Berechnung von SVaR, kalibriert auf verschiedene ununterbrochene 12-Monats-Zeiträume im Rahmen der in C107.02 Spalte 0010 angegebenen VaR-Meldestichtage, beginnend mit den in Spalte 0020 angegebenen Daten;</li> <li>d) wöchentliche Berechnung von SVaR, kalibriert auf verschiedene ununterbrochene 12-Monats-Zeiträume im Rahmen der in C107.02 Spalte 0010 angegebenen VaR-Meldestichtage, beginnend mit den in Spalte 0020 angegebenen Daten;</li> <li>e) Maximum der täglichen Berechnung von SVaR, kalibriert auf mehr als einen durchgehenden 12-Monats-Zeitraum;</li> <li>f) Maximum für die wöchentliche Berechnung des Risikopotenzials unter Stressbedingungen, kalibriert auf mehr als einen ununterbrochenen Zeitraum von 12 Monaten;</li> <li>g) Sonstige SVaR-Kalibrierung (bitte spezifizieren).</li> </ul> <p>Falls in Spalte 0010 Option a oder b ausgewählt wird, ist in Spalte 0020 das Startdatum im Format ‚TT/MM/JJJJ‘ anzugeben. Wird in Spalte 0010 die Option c oder d ausgewählt, sind die Startdaten für jede sVaR-Berechnung im Format ‚TT/MM/JJJJ‘ anzugeben. Wird in Spalte 0010 Option e, f oder g ausgewählt, so ist in Spalte 0020 auch anzugeben, welcher 12-Monats-Zeitraum für jede sVaR-Berechnung verwendet wird.</p>
------	---------------	-------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

C 107.02 — VaR, sVaR und PV — Nicht-CTP. Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Verordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Datum		Die Ergebnisse für VaR, sVaR und Barwert (present value — PV) sind für alle 10 Geschäftstage zwischen dem ‚ersten RM-Referenzdatum‘ und dem ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ‘ zu befolgen.
0020	VaR	Artikel 365 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Aufsichtlicher 10-Tages-VaR-Wert für jedes Portfolio, ohne Anwendung des aufsichtlichen Multiplikationsfaktors von ‚mindestens 3‘. Für jedes in Spalte 0010 angegebene Datum ist ein Wert auszuweisen. Berechnet das Institut keinen VaR-Wert für das in Spalte 0010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).
0030	sVaR	Artikel 365 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Aufsichtlicher 10-Tages-sVaR-Wert für jedes Portfolio, ohne Anwendung des aufsichtlichen Multiplikationsfaktors von ‚mindestens 3‘. Für jedes in Spalte 0010 angegebene Datum ist ein Wert auszuweisen. Berechnet das Institut keinen sVaR-Wert für das in Spalte 0010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).
0040	PV		Angabe des Barwerts (PV) für jedes Portfolio. Für jedes in Spalte 0010 angegebene Datum ist ein Wert auszuweisen. Berechnet das Institut keinen PV für das in Spalte 0010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).

**C 108.00 — Gewinn- und Verlust-Zeitreihen**

Meldebogen C 108.00 (Gewinn- & Verlust-Zeitreihen) ist nur von Instituten auszufüllen, die VaR mittels historischer Simulation berechnen.

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Verordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Datum	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	An jedem Geschäftstag gemäß dem im Sitzland des Instituts gültigen Kalenderjahr geben die Institute die für die VaR-Berechnung in Spalte 0010 von Meldebogen C 107.02 verwendeten GuV-Reihen mit mindestens 250 Beobachtungswerten ab dem letzten RM- (und dem letzten SBM-)Referenzdatum (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b Ziffer v dieser Verordnung) zurückreichend an.
0020	Tägliche GuV		Institute, die VaR mittels historischer Simulation berechnen, tragen die vollständigen vom Institut verwendeten historischen Datenreihen mit mindestens ein Jahr umfassenden Datenreihen und mit der anhand historisch simulierter täglicher Risikofaktorveränderungen am Portfolio vorgenommenen Bewertungsänderung (d. h. tägliche GuV) ein (d. h. tägliche GuV-Reihen, die zur Ableitung des aufsichtlichen 1-Tages-VaR verwendet werden).  Fällt ein Tag im Sitzland des Instituts auf einen gesetzlichen Feiertag, ist das Feld frei zu lassen (d. h. eine GuV von null ist nur dann einzutragen, wenn der hypothetische Wert des Portfolios an einem bestimmten Geschäftstag tatsächlich unverändert ist).

C 109.01 — IRC. Nähere Angaben zum Modell

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Anzahl der Modellierungsfaktoren		<p>EBA/GL/2012/3</p> <p>Angabe der Anzahl der Modellierungsfaktoren auf der Ebene des IRC-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) 1 Modellierungsfaktor;</li> <li>b) 2 Modellierungsfaktoren;</li> <li>c) Mehr als 2 Modellierungsfaktoren.</li> </ul> <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.</p>
0020	Herkunft der LGDs		<p>EBA/GL/2012/3</p> <p>Angabe der Herkunft der LGDs auf der Ebene des IRC-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) Marktkonvention;</li> <li>b) LGD aus IRB;</li> <li>c) Sonstige Herkunft der LGD (bitte angeben).</li> </ul> <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option c ausgewählt, sind dazu in dieser Spalte nähere Angaben zu machen.</p>

## C 109.02 — IRC. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Verordnung nur für Portfolios, für die IRC-Berechnungen verlangt werden.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Liquiditätshorizont	Artikel 374 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Angabe des auf Portfolioebene angewandten Liquiditätshorizonts. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Bis zu 3 Monate; b) Mehr als 3 bis zu 6 Monate; c) Mehr als 6 bis zu 9 Monate; d) Mehr als 9 bis zu 12 Monate.
0020	Herkunft der PDs		EBA/GL/2012/3 Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten PDs. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Ratingagenturen; b) IRB; c) Marktimplizierte PDs; d) Sonstige Herkunft der PDs (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind hier in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.
0030	Herkunft der Übergangsmatrizen		EBA/GL/2012/3 Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten Übergangsmatrizen. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Ratingagenturen; b) IRB; c) Marktimplizierte Übergangsmatrizen; d) Sonstige Herkunft der Übergangsmatrizen (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind hier in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.

**C 109.03 — IRC. Betrag nach Portfolio/Datum**

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Verordnung nur für Portfolios, für die IRC-Berechnungen verlangt werden.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Datum		IRC ist für alle 10 Geschäftstage zwischen dem ‚ersten RM-Referenzdatum‘ und dem ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ‘ zu befolgen.
0020	IRC	Artikel 372 bis 376 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Angabe des aufsichtlichen IRC-Werts für jedes Portfolio. Für jedes in Spalte 0010 angegebene Datum ist ein Wert auszuweisen. Berechnet das Institut keine IRC für das in Spalte 0010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).

## C 110.01 — CT. Nähere Angaben zum Modell

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Anzahl der Modellierungsfaktoren	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Angabe der Anzahl der Modellierungsfaktoren auf der Ebene des Korrelationshandels-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) 1 Modellierungsfaktor;</li> <li>b) 2 Modellierungsfaktoren;</li> <li>c) Mehr als 2 Modellierungsfaktoren.</li> </ul> <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.</p>
0020	Herkunft der LGDs	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Angabe der Herkunft der LGDs auf der Ebene des Korrelationshandels-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) Marktkonvention;</li> <li>b) LGD aus IRB;</li> <li>c) Sonstige Herkunft der LGD (bitte angeben).</li> </ul> <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option c ausgewählt, sind dazu in dieser Spalte nähere Angaben zu machen.</p>

C 110.02 — CT. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Verordnung nur für Portfolios, für die APR-Berechnungen verlangt werden.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Liquiditätshorizont	Artikel 377 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe des auf Portfolioebene angewandten Liquiditätshorizonts. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Bis zu 3 Monate; b) Mehr als 3 bis zu 6 Monate; c) Mehr als 6 bis zu 9 Monate; d) Mehr als 9 bis zu 12 Monate.
0020	Herkunft der PDs	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten PDs. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Ratingagenturen; b) IRB; c) Marktimplizierte PDs; d) Sonstige Herkunft der PDs (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.
0030	Herkunft der Übergangsmatrizen	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten Übergangsmatrizen. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Ratingagenturen; b) IRB; c) Marktimplizierte Übergangsmatrizen; d) Sonstige Herkunft der Übergangsmatrizen (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.

## C 110.03 — CT. APR nach Portfolio/Datum

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Verordnung nur für Portfolios, für die APR-Berechnungen verlangt werden.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Datum	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	APR („All-Price-Risk“) ist für alle 10 Geschäftstage zwischen dem ‚ersten RM-Referenzdatum‘ und dem ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/YYYY‘ zu befolgen.
0060	APR	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben sind die Ergebnisse der Anwendung des aufsichtlichen Korrelationshandelsmodells auf jedes Portfolio. Für jedes in Spalte 0010 angegebene Datum ist ein Wert auszuweisen. Verwendet das Institut für das in Spalte 0010 angegebene Datum kein Korrelationshandelsmodell, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Berechnungsergebnis tatsächlich gleich null ist).

**C 120.01 — SBM. RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO**

Hier melden die Institute — Instrument für Instrument — die Sensitivitäten gegenüber den Risikofaktoren, denen das Instrument ausgesetzt ist. Dabei ist ein Risikofaktor/eine Sensitivität pro Zeile anzugeben. Die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition des betreffenden Risikofaktors (CVRk+) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk-) im Sinne von Artikel 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist in eigenen Zeilen zu melden. Alle Werte sind auf das ‚letzte RM- (und das letzte ASA-)Referenzdatum‘ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b Ziffer v dieser Verordnung) zu beziehen. Die Institute dürfen jede Kombination aus Portfolio, Instrumentennummer (Spalte 0010), Risikokennung (Spalte 0020), Unterklasse (Spalte 0030) und Zusätzlicher Kennung (Spalte 0040) nur einmal melden.

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des einzelnen und aggregierten Portfolios aus Anhang V dieser Verordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V dieser Verordnung.
0020	Risikofaktor-Kennung	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben ist die einschlägige Risikofaktor-Kennung aus der Tabelle am Ende dieses Anhangs.
0030	Unterklasse	Artikel 325d Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Unterklasse auszuweisen, je nachdem, welcher Risikoklasse die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktor-Kennung entspricht: <ul style="list-style-type: none"> <li>— Allgemeines Zinsrisiko. Anzugeben ist die Währung des Risikofaktors maßgebliche risikofreie Zinssätze, Inflationsrisiko oder Basis-Währungsrisiko (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR‘).</li> <li>— Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen. Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ah Absatz 1 Tabelle 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013.</li> <li>— Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR Nicht-ACTP). Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325am Absatz 1 Tabelle 7 der genannten Verordnung.</li> <li>— Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR ACTP). Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ak Tabelle 6 der genannten Verordnung.</li> <li>— Aktienkursrisiko. Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ap Absatz 1 Tabelle 8 der genannten Verordnung.</li> </ul>

			<ul style="list-style-type: none"> <li>— Warenpositionsrisiko. Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325as Tabelle 9 der genannten Verordnung.</li> <li>— Fremdwährungsrisiko und Komponenten Delta oder Krümmung. Anzugeben ist die Währung (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ,USD').</li> <li>— Fremdwährungsrisiko und Komponente Vega. Anzugeben ist das Währungspaar (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ,EUR_USD').</li> </ul>
0040	Zusätzliche Kennung 1	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung Nr. 575/2013 (EU)	<p>Um den Risikofaktor innerhalb der Unterklasse genauer zu kennzeichnen, werden die nachstehend ausgeführten Angaben gemeldet. Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— Allgemeines Zinsrisiko und Delta-Komponente, so ist die Bezeichnung der risikofreien Kurve oder eine andere entsprechende eindeutige Kennung anzugeben;</li> <li>— Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen oder der Risikoklasse Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR ACTP), so ist der Name des Emittenten oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben;</li> <li>— Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR Nicht-ACTP), so ist die Bezeichnung der Tranche oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben;</li> <li>— Aktienkursrisiko, so ist die Aktienemittenten-Adresse oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben;</li> <li>— Warenpositionsrisiko, so ist die Bezeichnung der Ware oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben.</li> </ul> <p>Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist ein Leerwert (NUL) anzugeben.</p>
0060	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325g, 325r, 325s, 325 t und 325ax der Verordnung Nr. 575/2013 (EU)	<p>Die Risikosensitivitäten (Delta/Vega-Sensitivitäten und Krümmungsrisikopositionen) sind für alle in den Spalten 0020 bis 0040 genannten relevanten Risikofaktoren auf der Ebene des einzelnen Instruments anzugeben. Für die Angaben dieser Werte ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts zu verwenden. Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktor-Kennung</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Netto-Sensitivität gegenüber dem Risikofaktor (<math>S_k</math>) im Sinne von Artikel 325r der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben; Haben die Institute von ihrer zuständigen Behörde die Erlaubnis zur Verwendung alternativer Definitionen der Delta-Risikosensitivitäten nach Artikel 325 t Absatz 5 der genannten Verordnung erhalten, so beziehen sie sich bei ihrer Meldung auf diese alternativen Definitionen.</li> </ul>

			<ul style="list-style-type: none"> <li>— der Vega-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Vega-Risikosensitivität einer Option gegenüber einem gegebenen Risikofaktor (<math>S_k</math>) im Sinne von Artikel 325s der genannten Verordnung anzugeben; Haben die Institute von ihrer zuständigen Behörde die Erlaubnis für alternative Berechnungen der Vega-Risikosensitivitäten nach Artikel 325 t Absatz 6 der genannten Verordnung erhalten, so beziehen sie sich bei ihrer Meldung auf diese alternativen Definitionen. Unabhängig davon, ob das Institut die Berechnung nach Artikel 325s oder eine alternative Kalkulation nach Artikel 325 t Absatz 6 der genannten Verordnung verwendet, ist die Sensitivität nach Gewichtung mit der entsprechenden impliziten Volatilität anzugeben.</li> <li>— der Krümmungsrisikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (<math>CVR_k^+</math>) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (<math>CVR_k^-</math>) im Sinne von Artikel 325g der genannten Verordnung anzugeben.</li> </ul> <p>Die gemeldete Zahl ist mit einer Genauigkeit von mindestens zwei Dezimalstellen anzugeben. Nullwerte sind nur dann anzugeben, wenn die Berechnung tatsächlich null ergibt.</p>
0070	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217, z. B. „EUR“).
0080	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung und Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325g, 325r, 325s, 325 t und 325ax der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0060 anzugeben, allerdings umgerechnet zum EZB-Kassakurs für die Währung des Portfolios im Sinne von Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung.
0090	Risikogewicht	Teil 3 Titel IV Kapitel 1a Abschnitt 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben ist das entsprechende Risikogewicht für den Risikofaktor aus Spalte 0020 bis 0040. Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktorkennung der Krümmungsrisikokomponente, ist das Risikogewicht anzugeben, das zur Ermittlung der anwendbaren relativen Verschiebung angewandt wurde. Die gemeldete Zahl ist mit einer Genauigkeit von mindestens vier Dezimalstellen anzugeben.

0110	Zusätzliche Kennung 2	Artikel 325p Absatz 2 der Verordnung Nr. 575/2013 (EU)	Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse Warenpositionsrisiko und der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so sind die rechtlichen Bestimmungen in Bezug auf den Lieferort oder eine andere entsprechende eindeutige Kennung anzugeben. Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist ein Leerwert (NUL) anzugeben.
0120	Bonitätskategorie	Artikel 325m Absatz 1 und Artikel 325ah Absatz 1 der Verordnung Nr. 575/2013 (EU)	Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen und der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: a) ‚Bonitätsstufe 1‘; b) ‚Bonitätsstufe 2‘; c) ‚Bonitätsstufe 3‘; d) ‚Bonitätsstufe 4‘; e) ‚Bonitätsstufe 5‘; f) ‚Bonitätsstufe 6‘; g) ‚Keine Bonitätsstufe (unbeurteilt)‘. Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist ein Leerwert (NUL) anzugeben.

C120.02 — **SBM. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO**

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des einzelnen und aggregierten Portfolios aus Anhang V dieser Verordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Risikoklasse	Artikel 325d Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Risikoklasse. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) ‚Allgemeines Zinsrisiko (GIRR)‘; b) ‚Kreditspreadrisiko. CSR bei Nicht-Verbriefungspositionen‘ (Kreditspreadrisiko (CSR) bei Nicht-Verbriefungspositionen); c) ‚Kreditspreadrisiko. CSR bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘ (CSR außerhalb des alternativen Korrelationshandelsportfolios)); d) ‚Kreditspreadrisiko. CSR bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘ (CSR des alternativen Korrelationshandelsportfolios); e) ‚Aktienkursrisiko‘; f) ‚Warenpositionsrisiko‘; g) ‚Fremdwährungsrisiko‘.
0020	Komponente	Artikel 325e Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Komponente der sensitivitätsgestützten Methode. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) ‚Delta-Risiko‘; b) ‚Vega-Risiko‘; c) ‚Krümmungsrisiko‘.
0030	Korrelations-szenario	Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe des Korrelationsszenarios. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Szenario ‚mittlere Korrelation‘; b) Szenario ‚hohe Korrelation‘; c) Szenario ‚niedrige Korrelation‘.
0040	Eigenmittel-anforderungen (Ergebnisse in Währung der Rechnungslegung)	Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte für die Eigenmittelanforderungen sind für jedes Portfolio für alle relevanten Kombinationen aus Risikoklasse, Komponente und Korrelationsszenario zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (gemäß Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben. Die Werte sind in der Währung der Rechnungslegung des Instituts und mit einer Genauigkeit von mindestens zwei Dezimalstellen anzugeben.

0050	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217).
0060	Eigenmittel-anforderungen (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung und Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0040 anzugeben, allerdings umgerechnet zum EZB-Kassakurs für die Währung des Portfolios im Sinne von Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung.
0070	Positionen ohne Optionalität, die Eigenmittelanforderungen in Bezug auf das Krümmungsrisiko unterliegen	Artikel 325e Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die Komponente in Spalte 0020 dem Krümmungsrisiko, ist Folgendes anzugeben: a) Wendet das Institut zur Berechnung des in den Spalten 0040 und 0060 ausgewiesenen Ergebnisses den Ansatz nach Artikel 325e Absatz 3 Unterabsatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 an, ist „JA“ anzugeben. b) Andernfalls ist „NEIN“ anzugeben. „NEIN“ ist auch dann anzugeben, wenn keine der vorstehenden Möglichkeiten zutrifft.
0080	Basiswährungs-ansatz für Delta-Faktor- und Krümmungs-risikofaktoren des Fremdwährungs-risikos	Artikel 325q Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die Risikoklasse in Spalte 0010 dem Fremdwährungsrisiko und die Komponente in Spalte 0020 dem Delta-Faktor- oder Krümmungsrisiko, ist Folgendes anzugeben: a) Wendet das Institut zur Berechnung des in den Spalten 0040 und 0060 ausgewiesenen Ergebnisses den Ansatz nach Artikel 325q Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 an, ist „JA“ anzugeben. b) Andernfalls ist „NEIN“ anzugeben. „NEIN“ ist auch dann anzugeben, wenn keine der vorstehenden Möglichkeiten zutrifft.
0090	Division der Krümmungs- risikokomponenten für das Fremdwährungs- risiko durch Skalare	Artikel 325q Absatz 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die Risikoklasse in Spalte 0010 dem Fremdwährungsrisiko und die Komponente in Spalte 0020 dem Krümmungsrisiko, ist Folgendes anzugeben: a) Wendet das Institut zur Berechnung des in den Spalten 0040 und 0060 ausgewiesenen Ergebnisses den Ansatz nach Artikel 325q Absatz 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 an, ist „JA“ anzugeben. b) Andernfalls ist „NEIN“ anzugeben. „NEIN“ ist auch dann anzugeben, wenn keine der vorstehenden Möglichkeiten zutrifft.
0100	Freitextfeld		In dieser Spalte kann das Institut zusätzliche Angaben machen.

C 120,04 — **DRC. MARKTWERTE UND JUMP-TO-DEFAULT-(JTD-)BRUTTOBETRÄGE NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO**

Hier melden die Institute die Risikopositionen für jedes einzelne Instrument. Dabei ist für jede Risikoposition eine Zeile auszufüllen. Alle Werte sind auf das ‚letzte RM- (und das letzte ASA-)Referenzdatum‘ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b Ziffer v dieser Verordnung) zu beziehen. Die Risikopositionen sind vor einer etwaigen Aufrechnung, aber, sofern anwendbar, nach Replikations- oder Aufschlüsselungsschritten (im Sinne der Artikel 325z und 325ac der Verordnung (EU) Nr. 575/2013) auszuweisen.

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des einzelnen und aggregierten Portfolios aus Anhang V dieser Verordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V dieser Verordnung.
0020	Risikoklasse	Artikel 325v Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Risikoklasse anzugeben, für die die Anforderung für das Ausfallrisiko in den Spalten 0030 und 0040 ausgewiesen wird. Auszuwählen ist eine der folgenden Arten von Instrumenten: a) ‚Instrumente, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt‘; b) ‚Nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘; c) ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘.
0030	Unterklasse 1	Artikel 325y Absatz 3, Artikel 325aa Absatz 4 und Artikel 325ad Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Unterklasse auszuweisen. Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚Nicht-Verbriefungspositionen‘, ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: a) ‚Unternehmen‘; b) ‚Staaten‘; c) ‚Gebietskörperschaften/Kommunen‘. Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse hingegen ‚Verbriefungspositionen‘, ist entweder Möglichkeit a) von oben oder eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: d) ‚ABCP — Asien‘; e) ‚ABCP — Europa‘; f) ‚ABCP — Nordamerika‘; g) ‚ABCP — übrige Welt‘; h) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings — Asien‘;

- |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  | <ul style="list-style-type: none"> <li>i) ,Kfz-Darlehen und -Leasings — Europa‘;</li> <li>j) ,Kfz-Darlehen und -Leasings — Nordamerika‘;</li> <li>k) ,Kfz-Darlehen und -Leasings — übrige Welt‘;</li> <li>l) ,Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) — Asien‘;</li> <li>m) ,Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) — Europa‘;</li> <li>n) ,Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) — Nordamerika‘;</li> <li>o) ,Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) — übrige Welt‘;</li> <li>p) ,Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere — Asien‘;</li> <li>q) ,Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere — Europa‘;</li> <li>r) ,Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere — Nordamerika‘;</li> <li>s) ,Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere — übrige Welt‘;</li> <li>t) ,Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) — Asien‘;</li> <li>u) ,Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) — Europa‘;</li> <li>v) ,Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) — Nordamerika‘;</li> <li>w) ,Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) — übrige Welt‘;</li> <li>x) ,Kreditkarten — Asien‘;</li> <li>y) ,Kreditkarten — Europa‘;</li> <li>z) ,Kreditkarten — Nordamerika‘;</li> <li>(aa) ,Kreditkarten — übrige Welt‘;</li> <li>(bb) ,Sonstige Privatkundenkredite — Asien‘;</li> <li>(cc) ,Sonstige Privatkundenkredite — Europa‘;</li> <li>(dd) ,Sonstige Privatkundenkredite — Nordamerika‘;</li> <li>(ee) ,Sonstige Privatkundenkredite — übrige Welt‘;</li> <li>(ff) ,Sonstige Großkundenkredite — Asien‘;</li> <li>(gg) ,Sonstige Großkundenkredite — Europa‘;</li> <li>(hh) ,Sonstige Großkundenkredite — Nordamerika‘;</li> <li>ii) ,Sonstige Großkundenkredite — übrige Welt‘;</li> <li>(jj) ,Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) — Asien‘;</li> <li>(kk) ,Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) — Europa‘;</li> <li>(ll) ,Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) — Nordamerika‘;</li> <li>(mm) ,Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) — übrige Welt‘;</li> <li>(nn) ,Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) — Asien‘;</li> </ul> |
|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

			<p>(oo) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) — Europa‘;                  (pp) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) — Nordamerika‘;                  (qq) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) — übrige Welt‘;                  (rr) ‚Studiendarlehen — Asien‘;                  (ss) ‚Studiendarlehen — Europa‘;                  (tt) ‚Studiendarlehen — Nordamerika‘;                  (uu) ‚Studiendarlehen- übrige Welt‘.</p> <p>Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse hingegen ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘, so ist ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘ anzugeben.</p>
0040	Unterklasse 2	Artikel 325ad Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘, so ist die Bezeichnung des Index oder andernfalls ‚NUL‘ anzugeben.
0050	Schuldner	Artikel 325v Absatz 2, Artikel 325x Absatz 1 sowie Artikel 325z und 325ac der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Die Banken melden Angaben zum Schuldner. Ist die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— ‚Instrumente, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt‘, so ist der Name des Schuldners anzugeben;</li> <li>— ‚Nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘, so ist der Name des Schuldners oder eine eindeutige Kennung des zugrunde liegenden Aktiva-Pools und der Tranche anzugeben;</li> <li>— ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘, so ist die eindeutige Kennung der Indexfamilie,- reihe und -tranche anzugeben;</li> </ul>
0060	Bonitätskategorie	Artikel 325y Absätze 1 und 2, Artikel 325aa Absatz 1 und Artikel 325ad Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Hier geben die Institute die Bonitätskategorie an. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) ‚Bonitätsstufe 1‘;</li> <li>b) ‚Bonitätsstufe 2‘;</li> <li>c) ‚Bonitätsstufe 3‘;</li> <li>d) ‚Bonitätsstufe 4‘;</li> <li>e) ‚Bonitätsstufe 5‘;</li> <li>f) ‚Bonitätsstufe 6‘;</li> <li>g) ‚Keine zugewiesene Bonitätsstufe (unbeurteilt)‘;</li> <li>h) ‚Keine zugewiesene Bonitätsstufe (ausgefallen)‘;</li> <li>i) ‚Keine zugewiesene Bonitätsstufe (Risikogewicht 0 %)‘.</li> </ul>

			<p>Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘ oder ‚Nicht in das Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘, so ist entweder eine der vorgenannten Möglichkeiten oder Folgendes anzugeben:</p> <p>j) ‚Bonitätsstufe 7‘;  k) ‚Bonitätsstufe 8‘;  l) ‚Bonitätsstufe 9‘;  m) ‚Bonitätsstufe 10‘;  n) ‚Bonitätsstufe 11‘;  o) ‚Bonitätsstufe 12‘;  p) ‚Bonitätsstufe 13‘;  q) ‚Bonitätsstufe 14‘;  r) ‚Bonitätsstufe 15‘;  s) ‚Bonitätsstufe 16‘;  t) ‚Bonitätsstufe 17‘;  u) ‚Alle sonstigen Bonitätsstufen‘;</p>
0070	Ausfallrisiko-gewicht	Artikel 325v Absatz 1 Buchstabe f, Artikel 325y Absätze 1 und 2, Artikel 325aa Absatz 1 und Artikel 325ad Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier geben die Institute das einschlägige Risikogewicht an. Die auf Verbriefungspositionen angewandten Risikogewichte sind gemäß Artikel 325aa Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 nach der Multiplikation mit 8 % auszuweisen.
0080	Rang	Artikel 325w Absätze 3 und 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Hier ist der Rang der Risikoposition anzugeben: Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt‘ oder ‚Nicht in das Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘, so ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben:</p> <p>a) ‚Eigenkapitalinstrumente‘;  b) ‚Nicht vorrangige Schuldtitel‘;  c) ‚Vorrangige Schuldtitel‘;  d) ‚Gedckte Schuldverschreibungen‘.</p> <p>Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist das Feld leer zu lassen.</p>
0090	Laufzeit	Artikel 325x, 325z und 325ac der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist der Fälligkeitstermin der Risikoposition anzugeben. Hierbei ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ‘ zu befolgen.

0100	Erlösquote	Artikel 325v Absatz 1 Buchstabe e der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier geben die Institute die Erlösquote an. Die Erlösquote wird anhand der anwendbaren Verlustquote bei Ausfall (LGD) berechnet als Erlösquote = $1 - \text{LGD}$ . Die gemeldete Erlösquote ist mit einer Genauigkeit von mindestens vier Dezimalstellen als Dezimalwert zwischen 0 und 1 anzugeben.
0110	Richtung	Artikel 325v Absatz 1 Buchstaben a und b der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier geben die Institute die Richtung der Risikoposition im Sinne der Begriffsbestimmungen in Artikel 325v Absatz 1 Buchstaben a und b der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 an. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) ‚Short-Risikoposition‘; b) ‚Long-Risikoposition‘.
0120	Unterer Tranchierungs-punkt (%)	Artikel 325aa und 325ad der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Bezieht sich die ausgewiesene Risikoposition auf eine Tranche, müssen die Institute den unteren Tranchierungspunkt der Tranche angeben. Die gemeldete Zahl ist mit einer Genauigkeit von mindestens vier Dezimalstellen anzugeben.
0130	Oberer Tranchierungs-punkt (%)	Artikel 325aa und 325ad der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Bezieht sich die ausgewiesene Risikoposition auf eine Tranche, müssen die Institute den oberen Tranchierungspunkt der Tranche angeben. Die gemeldete Zahl ist mit einer Genauigkeit von mindestens vier Dezimalstellen anzugeben.
0140-01-70	Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung		Die Werte sind bezogen auf die Währung der Rechnungslegung des Instituts und mit einer Genauigkeit von mindestens zwei Dezimalstellen, sofern anwendbar, anzugeben.
0140	Nominalbetrag	Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt‘, geben die Institute den Nominalbetrag des Instruments an. Der angegebene Wert muss, je nach Risikoposition, entweder dem Term $V_{\text{notional}}$ in Artikel 325w Absätze 1 und 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder dem Term $V$ in Artikel 325w Absatz 5 der genannten Verordnung entsprechen. Trifft keiner der vorgenannten Fälle zu oder wird der in dieser Spalte auszuweisende Betrag vom Institut nicht ausdrücklich berechnet oder zur Schätzung des JTD-Bruttobetrags herangezogen, so ist dieses Feld leer zu lassen.

0150	GuV + Anpassung (P&L + Adjustment)	Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Die Institute geben für jede Risikoposition die Summe aus GuV und Anpassung an:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Vertriebspositionen handelt‘ und ist die ausgewiesene Risikoposition eine Long-Risikoposition, so geben die Institute gemäß Artikel 325w Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 die Summe aus <math>P\&amp;L_{long}</math> und <math>Adjustment_{long}</math> an.</li> <li>— Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Vertriebspositionen handelt‘ und ist die ausgewiesene Risikoposition eine Short-Risikoposition, so geben die Institute gemäß Artikel 325w Absatz 2 der genannten Verordnung die Summe aus <math>P\&amp;L_{short}</math> und <math>Adjustment_{short}</math> an.</li> <li>— Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Vertriebspositionen handelt‘ und ist die ausgewiesene Risikoposition eine Risikoposition in Eigenkapitalinstrumenten, so geben die Institute gemäß Artikel 325w Absatz 5 der genannten Verordnung die Summe aus <math>P\&amp;L_{long}</math> und <math>Adjustment_{long}</math> an, wenn es sich bei der Risikoposition um eine Long-Risikoposition handelt, und die Summe aus <math>P\&amp;L_{short}</math> und <math>Adjustment_{short}</math>, wenn es sich bei der Risikoposition um eine Short-Risikoposition handelt.</li> </ul> <p>Trifft keiner der vorgenannten Fälle zu oder wird der in dieser Spalte auszuweisende Betrag vom Institut nicht ausdrücklich berechnet oder zur Schätzung des JTD-Bruttobetrags herangezogen, so ist dieses Feld leer zu lassen.</p>
0160	JTD-Bruttobetrag	Artikel 325v Absatz 1 Buchstabe c, Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5, Artikel 325z Absatz 1 und Artikel 325ac Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier geben die Institute den Jump-to-Default-(JTD-)Bruttobetrag an.
0170	Währung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217).
0180-02-00	Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung sowie Artikel 325y, 325aa und 325ad der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0030 anzugeben, allerdings umgerechnet zum EZB-Kassakurs für die Währung des Portfolios im Sinne von Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung.

0180	Nominalbetrag	Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt‘, geben die Institute den Nominalbetrag des Instruments an. Der angegebene Wert muss, je nach Risikoposition, entweder dem Term <math>V_{\text{notional}}</math> in Artikel 325w Absätze 1 und 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder dem Term <math>V</math> in Artikel 325w Absatz 5 der genannten Verordnung entsprechen.</p> <p>Trifft keiner der vorgenannten Fälle zu oder wird der in dieser Spalte auszuweisende Betrag vom Institut nicht ausdrücklich berechnet oder zur Schätzung des JTD-Bruttobetrags herangezogen, so ist dieses Feld leer zu lassen.</p>
0190	GuV + Anpassung (P&L + Adjustment)	Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Die Institute geben für jede Risikoposition die Summe aus GuV und Anpassung an:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt‘ und ist die ausgewiesene Risikoposition eine Long-Risikoposition, so geben die Institute gemäß Artikel 325w Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 die Summe aus <math>P\&amp;L_{\text{long}}</math> und <math>\text{Adjustment}_{\text{long}}</math> an.</li> <li>— Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt‘ und ist die ausgewiesene Risikoposition eine Short-Risikoposition, so geben die Institute gemäß Artikel 325w Absatz 2 der genannten Verordnung die Summe aus <math>P\&amp;L_{\text{short}}</math> und <math>\text{Adjustment}_{\text{short}}</math> an.</li> </ul> <p>Trifft keiner der vorgenannten Fälle zu oder wird der in dieser Spalte auszuweisende Betrag vom Institut nicht ausdrücklich berechnet oder zur Schätzung des JTD-Bruttobetrags herangezogen, so ist dieses Feld leer zu lassen.</p>
0200	JTD-Bruttobetrag	Artikel 325v Absatz 1 Buchstabe c, Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5, Artikel 325z Absatz 1 und Artikel 325ac Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Hier geben die Institute den Jump-to-Default-(JTD-)Bruttobetrag an.</p>

## C 120.05 — DRC. EIGENMITTELANFORDERUNGS-(OFR)-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des einzelnen und aggregierten Portfolios aus Anhang V dieser Verordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Risikoklasse	Artikel 325v Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Risikoklasse anzugeben, für die die Anforderungen für das Ausfallrisiko in den Spalten 0030 und 0040 ausgewiesen werden. Auszuwählen ist eine der folgenden Arten von Instrumenten: a) ‚Instrumente, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt‘; b) ‚Nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘; c) ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘.
0020	Unterklasse 1	Artikel 325y Absatz 3, Artikel 325aa Absatz 4 und Artikel 325ad Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Unterklasse auszuweisen. Entspricht die in Spalte 0010 ausgewiesene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt‘, ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: a) ‚Unternehmen‘; b) ‚Staaten‘; c) ‚Gebietskörperschaften/Kommunen‘. Entspricht die in Spalte 0010 ausgewiesene Risikoklasse hingegen ‚Nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘, ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: d) ‚ABCP — Asien‘; e) ‚ABCP — Europa‘; f) ‚ABCP — Nordamerika‘; g) ‚ABCP — übrige Welt‘; h) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings — Asien‘; i) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings — Europa‘; j) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings — Nordamerika‘; k) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings — übrige Welt‘; l) ‚Quadierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) — Asien‘; m) ‚Quadierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) — Europa‘;

- n) ‚Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) — Nordamerika‘;
- o) ‚Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) — übrige Welt‘;
- p) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere — Asien‘;
- q) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere — Europa‘;
- r) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere — Nordamerika‘;
- s) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere — übrige Welt‘;
- t) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) — Asien‘;
- u) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) — Europa‘;
- v) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) — Nordamerika‘;
- w) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) — übrige Welt‘;
- x) ‚Kreditkarten — Asien‘;
- y) ‚Kreditkarten — Europa‘;
- z) ‚Kreditkarten — Nordamerika‘;
- (aa) ‚Kreditkarten — übrige Welt‘;
- (bb) ‚Sonstige Privatkundenkredite — Asien‘;
- (cc) ‚Sonstige Privatkundenkredite — Europa‘;
- (dd) ‚Sonstige Privatkundenkredite — Nordamerika‘;
- (ee) ‚Sonstige Privatkundenkredite — übrige Welt‘;
- (ff) ‚Sonstige Großkundenkredite — Asien‘;
- (gg) ‚Sonstige Großkundenkredite — Europa‘;
- (hh) ‚Sonstige Großkundenkredite — Nordamerika‘;
- ii) ‚Sonstige Großkundenkredite — übrige Welt‘;
- (jj) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) — Asien‘;
- (kk) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) — Europa‘;
- (ll) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) — Nordamerika‘;
- (mm) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) — übrige Welt‘;
- (nn) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) — Asien‘;
- (oo) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) — Europa‘;
- (pp) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) — Nordamerika‘;
- (qq) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) — übrige Welt‘;
- (rr) ‚Studiendarlehen — Asien‘;
- (ss) ‚Studiendarlehen — Europa‘;

			<p>(tt) ‚Studiendarlehen — Nordamerika‘;</p> <p>(uu) ‚Studiendarlehen- übrige Welt‘.</p> <p>Entspricht die in Spalte 0010 ausgewiesene Risikoklasse ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘, so ist ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘ anzugeben.</p>
0030	Unterklasse 2	Artikel 325ad Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0010 ausgewiesene Risikoklasse ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘, so ist die Bezeichnung des Index anzugeben oder das Feld leer zu lassen („NUL“).
0040	Eigenmittel-anforderungen (Ergebnisse in Währung der Rechnungslegung)	Artikel 325y, 325aa und 325ad der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderungen für das Ausfallrisiko sind zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben. Die Werte sind in der Währung der Rechnungslegung des Instituts und mit einer Genauigkeit von mindestens zwei Dezimalstellen anzugeben.
0050	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217).
0060	Eigenmittelan-forderungen (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung sowie Artikel 325y, 325aa und 325ad der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0030 anzugeben, allerdings umgerechnet zum EZB-Kassakurs für die Währung des Portfolios im Sinne von Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung.

C 120.06 — ASA. OFR

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Portfolionummer	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des einzelnen und aggregierten Portfolios aus Anhang V dieser Verordnung.
0020-00-40	Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	
0020	SBM OFR	Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die nach der sensitivitätsgestützten Methode des alternativen Standardansatzes ermittelte Eigenmittelanforderung ist für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.
0030	DRC OFR	Artikel 325v der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderung für das Ausfallrisiko beim alternativen Standardansatz ist für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.
0040	RRAO OFR	Artikel 325u der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderungen für den Aufschlag für Restrisiken beim alternativen Standardansatz sind für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.
0050-00-70	Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Verwendet das Institut für seine Rechnungslegung eine andere als die in Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung genannten EBA-Portfolio-Währungen, so rechnet es seine Rechnungslegungswährung zum anwendbaren EZB-Kassakurs um.
0050	SBM OFR	Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die nach der sensitivitätsgestützten Methode des alternativen Standardansatzes ermittelte Eigenmittelanforderung ist für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.
0060	DRC OFR	Artikel 325v der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderung für das Ausfallrisiko beim alternativen Standardansatz ist für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.
0070	RRAO OFR	Artikel 325u der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderungen für den Aufschlag für Restrisiken beim alternativen Standardansatz sind für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum‘ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.

**Tabelle: Hinweise zum Ausfüllen der Meldebögen 106.01 (Spalte 0010) und 120.01 (Spalte 0020)**

- Die Spalte ‚Risikoklasse‘ bezieht sich auf Artikel 325d Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Für die Risikoklassen werden die folgenden Abkürzungen verwendet:
- ‚GIRR‘ (allgemeines Zinsrisiko);
  - ‚CSR\_NON\_SEC‘ (Kreditspreadrisiko (CSR) bei Nicht-Verbriefungspositionen);
  - ‚CSR\_SEC\_NON\_ACTP‘ (Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR Nicht-ACTP));
  - ‚CSR\_SEC\_ACTP‘ (Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR ACTP));
  - ‚EQ‘ (Aktienkursrisiko);
  - ‚CM‘ (Warenpositionsrisiko);
  - ‚FX‘ (Fremdwährungsrisiko).
- Die Spalte ‚Komponente‘ bezieht sich auf Artikel 325e Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Für die Komponenten der sensitivitätsgestützten Methode werden die folgenden Abkürzungen verwendet:
- ‚DELTA‘ (Delta-Risiko);
  - ‚VEGA‘ (Vega-Risiko);
  - ‚CURVATURE‘ (Krümmungsrisiko).
- Die Spalte ‚Laufzeit‘ bezieht sich auf die Laufzeit des Risikofaktors, wobei die Risikofaktoren nach den Artikeln 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anhand spezifizierter Scheitelpunkte definiert werden. Bei Vega-Risikofaktoren des allgemeinen Zinsrisikos im Sinne von Artikel 325l Absatz 7 der genannten Verordnung sind zwei Laufzeiten mit Trennstrich anzugeben (z. B. ‚0,5 Jahre — 0,5 Jahre‘), wobei die erste Angabe der Laufzeit der Option und die zweite der Restlaufzeit des Basiswerts der Option zum Ablaufdatum der Option entspricht.
- In der Spalte ‚Zusätzliche Angaben‘ sind genauere Angaben zum jeweiligen Risikofaktor einzutragen mit Blick auf die Unterscheidung zwischen Risikofaktoren des Inflationsrisikos und des Basis-Währungsrisikos im Sinne von Artikel 325 l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, zwischen Risikofaktoren bei Schuldtiteln und bei Kreditausfallswaps im Sinne von Artikel 325m und 325n der genannten Verordnung, zwischen Risikofaktoren des Eigenkapital-Kassakurses und des Eigenkapital-Reposatzes im Sinne von Artikel 325o der genannten Verordnung und zwischen der Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk+) und der Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk-) im Sinne von Artikel 325 g der genannten Verordnung.

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CM	DELTA	0 Jahre		CM_D_00.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	0,25 Jahre		CM_D_00.25	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	0,5 Jahre		CM_D_00.50	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	1 Jahr		CM_D_01.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	2 Jahre		CM_D_02.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	3 Jahre		CM_D_03.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

CM	DELTA	5 Jahre		CM_D_05.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	10 Jahre		CM_D_10.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	15 Jahre		CM_D_15.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	20 Jahre		CM_D_20.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	30 Jahre		CM_D_30.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	0,5 Jahre		CM_V_00.50	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	1 Jahr		CM_V_01.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	3 Jahre		CM_V_03.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	5 Jahre		CM_V_05.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	10 Jahre		CM_V_10.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	CM_CU	Artikel 325p und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	CM_CD	Artikel 325p und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 Jahre	Schuldtitle	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 Jahr	Schuldtitle	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 Jahre	Schuldtitle	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 Jahre	Schuldtitle	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 Jahre	Schuldtitle	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 Jahr	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

CSR_NON_SEC	DELTA	10 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 Jahre		CSR_NON_SEC_V_00.50	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	1 Jahr		CSR_NON_SEC_V_01.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	3 Jahre		CSR_NON_SEC_V_03.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	5 Jahre		CSR_NON_SEC_V_05.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	10 Jahre		CSR_NON_SEC_V_10.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CU	Artikel 325m und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CD	Artikel 325m und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 Jahr	Schuldtitle	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 Jahr	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 Jahr		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CU	Artikel 325n und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CD	Artikel 325n und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	1 Jahr	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	3 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	5 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	10 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	1 Jahr	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	3 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	10 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	0,5 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	1 Jahr		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	3 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	5 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	10 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Artikel 325n und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Artikel 325n und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	DELTA		Kassakurs	EQ_D_SPOT	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	DELTA		Reposatz	EQ_D_REPO	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	0,5 Jahre		EQ_V_00.50	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	1 Jahr		EQ_V_01.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	3 Jahre		EQ_V_03.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	5 Jahre		EQ_V_05.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	10 Jahre		EQ_V_10.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	EQ_CU	Artikel 325o und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	EQ_CD	Artikel 325o und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	DELTA			FX_D	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	0,5 Jahre		FX_V_00.50	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	1 Jahr		FX_V_01.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	3 Jahre		FX_V_03.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	5 Jahre		FX_V_05.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	10 Jahre		FX_V_10.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	FX_CU	Artikel 325q und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	FX_CD	Artikel 325q und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

GIRR	DELTA	0,25 Jahre		GIRR_D_00.25	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	0,5 Jahre		GIRR_D_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	1 Jahr		GIRR_D_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	2 Jahre		GIRR_D_02.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	3 Jahre		GIRR_D_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	5 Jahre		GIRR_D_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	10 Jahre		GIRR_D_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	15 Jahre		GIRR_D_15.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	20 Jahre		GIRR_D_20.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	30 Jahre		GIRR_D_30.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Inflation	GIRR_D_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_D_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_D_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre — 0,5 Jahre		GIRR_V_00.50_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr — 0,5 Jahre		GIRR_V_01.00_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre — 0,5 Jahre		GIRR_V_03.00_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre — 0,5 Jahre		GIRR_V_05.00_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre — 0,5 Jahre		GIRR_V_10.00_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre — 1 Jahr		GIRR_V_00.50_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

GIRR	VEGA	1 Jahr — 1 Jahr		GIRR_V_01.00_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre — 1 Jahr		GIRR_V_03.00_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre — 1 Jahr		GIRR_V_05.00_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre — 1 Jahr		GIRR_V_10.00_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre — 3 Jahre		GIRR_V_00.50_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr — 3 Jahre		GIRR_V_01.00_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre — 3 Jahre		GIRR_V_03.00_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre — 3 Jahre		GIRR_V_05.00_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre — 3 Jahre		GIRR_V_10.00_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre — 5 Jahre		GIRR_V_00.50_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr — 5 Jahre		GIRR_V_01.00_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre — 5 Jahre		GIRR_V_03.00_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre — 5 Jahre		GIRR_V_05.00_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre — 5 Jahre		GIRR_V_10.00_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre — 10 Jahre		GIRR_V_00.50_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr — 10 Jahre		GIRR_V_01.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre — 10 Jahre		GIRR_V_03.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

GIRR	VEGA	5 Jahre — 10 Jahre		GIRR_V_05.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre — 10 Jahre		GIRR_V_10.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre	Inflation	GIRR_V_00.50_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr	Inflation	GIRR_V_01.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre	Inflation	GIRR_V_03.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre	Inflation	GIRR_V_05.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre	Inflation	GIRR_V_10.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	GIRR_CU	Artikel 325l und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	GIRR_CD	Artikel 325l und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013