

## ANHANG VII

## Ergebnisse der aufsichtlichen Referenzportfolios. MARKTRISIKO

ERGEBNISSE DER REFERENZPORTFOLIOS. MARKTRISIKO			
Meldebogen-nummer	Meldebogen-code	Bezeichnung des Meldebogens/der Meldebogengruppe	Kurzbezeichnung
		<b>URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG</b>	
106,1	C 106.00	URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG UND GRÜNDE FÜR DIE NICHT EINBEZIEHUNG	IMV
106,2	C 106.01	RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT	SENSITIVITÄTEN
		<b>VaR, sVaR und PV</b>	
107,1	C 107.01	NÄHERE ANGABEN	VaR&sVaR 1
107,2	C 107.02	ERGEBNISSE IN DER <b>EBA-PORTFOLIO</b> -WÄHRUNG	VaR&sVaR 2
		<b>GEWINN- UND VERLUST-ZEITREIHEN</b>	
108	C 108.00	GEWINN- UND VERLUST-ZEITREIHEN	GuV
		<b>EIGENKAPITALANFORDERUNGEN FÜR ZUSÄTZLICHE RISIKEN (IRC)</b>	
109,1	C 109.01	IRC. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL	IRC 1
109,2	C 109.02	IRC. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS	IRC 2
109,3	C 109.03	IRC. BETRAG PRO PORTFOLIO/DATUM	IRC 3
		<b>KORRELATIONSHANDEL (CT)</b>	
110,1	C 110.01	CT. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL	CT 1
110,2	C 110.02	CT. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS	CT 2
110,3	C 110.03	CT. BETRAG NACH PORTFOLIO/DATUM	CT 3
		<b>ASA (SBM &amp; DRC)</b>	
120,1	C 120.01	SBM. RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO	SBM 1
120,2	C 120.02	SBM. OFR-Zusammensetzung nach Portfolio	SBM 2
120,4	C 120.04	DRC. MARKTWERTE UND JTD-BRUTTOBETRÄGE NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO	DRC 1
120,5	C 120.05	DRC. OFR-Zusammensetzung nach Portfolio	DRC 2
120,6	C 120.06	ASA. OFR NACH PORTFOLIO	ASA OFR

**C 106.00 — URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG UND GRÜNDE FÜR DIE NICHT EINBEZIEHUNG**

Nummer des Instruments	Modellierung des Instruments für VaR und sVaR (Ja/Nein)	Modellierung des Instruments für IRC (Ja/Nein)	Modellierung des Instruments für Korrelationshandel (Ja/Nein)	Grund für die Nicht einbeziehung	Freitextfeld	Ursprüngliche Marktbewertung
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

**C 106.01 – RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT**

Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Währung der Rechnungslegung	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung des EBA-Instruments)	Bewertungsmodell	Definition der Sensitivitäten	Freitextfeld	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

**C 107.01 – VaR, sVaR und PV. NÄHERE ANGABEN**

	Option	Freitextfeld
	0010	0020

**VaR**

0010	Methodik		
0020	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen		
0030	Länge des Beobachtungszeitraums		

0040	Datengewichtung		
0050	Backtesting-Zuschlagsfaktor		
0060	Aufsichtlicher VaR-Zuschlagsfaktor		

**sVaR**

0070	Methodik		
0080	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen		
0090	Aufsichtlicher sVaR-Zuschlagsfaktor		
0100	sVaR-Zeitraum		

**C 107.02 - VaR und SVaR NICHT-CTP. ERGEBNISSE IN DER EBA-PORTFOLIO-WÄHRUNG****Portfolio**


Datum	VaR	sVaR	PV
0010	0020	0030	0040

**C 108.00 – GEWINN- UND VERLUST-ZEITREIHEN**


Datum	Tägliche GuV
0010	0020

**C 109.01 – IRC. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL**

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	0010	0020
0010	Anzahl der Modellierungsfaktoren		
0020	Herkunft der LGDs		

**C 109.02 – IRC. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS**

**Portfolio**

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	0010	0020
0010	Liquiditätshorizont		
0020	Herkunft der PDs		
0030	Herkunft der Übergangsmatrizen		

**C 109.03 – IRC. BETRAG PRO PORTFOLIO/DATUM**

**Portfolio**

Datum	IRC
0010	0020

**C 110.01 – CT. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL**

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	0010	0020
0010	Anzahl der Modellierungsfaktoren		
0020	Herkunft der LGDs		

**C 110.02 – CT. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS****Portfolio**


		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	0010	0020
0010	Liquiditätshorizont		
0020	Herkunft der PDs		
0030	Herkunft der Übergangsmatrizen		

**C 110.03 – CT. APR NACH PORTFOLIO/DATUM****Portfolio**


Datum	APR
0010	0060

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

**Portfolio**

Nummer des Instruments	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Währung der Rechnungslegung	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)	Risikogewicht	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie
0010	0020	0030	0040	0060	0070	0080	0090	110	120

**C 120.02 – SBM. OFR-Zusammensetzung nach Portfolio**

**Portfolio**

Risikoklasse	Risikokomponente	Korrelationszenario	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in Währung der Rechnungslegung)	Währung der Rechnungslegung	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)	Positionen ohne Optionalität, die Eigenmittelanforderungen in Bezug auf das Krümmungsrisiko unterliegen	Basiswährungsansatz für Delta-Faktor und Krümmungsrisikofaktoren des Fremdwährungsrisikos	Division der Krümmungsrisikokomponenten für das Fremdwährungsrisiko durch Skalare	Freitextfeld
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100

**C 120.04 – DRC. Marktwerte und JTD-Bruttobeträge nach Instrument/Portfolio****Portfolio**

*Integer*

Nummer des Instruments	Risikoklasse	Unterklasse 1	Unterklasse 2	Schuldner	Bonitätskategorie	Ausfallrisikogewicht	Rang	Laufzeit	Erlösquote
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100

Richtung	Unterer Tranchierungspunkt (%)	Oberer Tranchierungspunkt (%)	Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung				Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung		
			Nominalbetrag	GuV + Anpassung (P&L + Adjustment)	JTD-Bruttobetrag	Währung	Nominalbetrag	GuV + Anpassung (P&L + Adjustment)	JTD-Bruttobetrag
0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

**C 120.05 – DRC. OFR-Zusammensetzung nach Portfolio****Portfolio**

*Integer*

Risikoklasse	Unterklasse 1	Unterklasse 2	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in Währung der Rechnungslegung)	Währung der Rechnungslegung	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

**C 120.06 – ASA. OFR**

Portfolionummer	Ergebnisse in der Wahrung der Rechnungslegung			Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Wahrung		
	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070