

„ANHANG VII

Ergebnisse der aufsichtlichen Referenzportfolios. MARKTRISIKO

ERGEBNISSE DER REFERENZPORTFOLIOS. MARKTRISIKO			
Melde-bogen-nummer	Melde-bogen-code	Bezeichnung des Meldebogens/Meldebogengruppe	Name (Kurzform)
		URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG	
106	C 106.00	URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG	IMV
		VaR, sVaR und PV	
107,1	C 107.01	ANGABEN	VaR und sVaR 1
107,2	C 107.02	ERGEBNISSE BASISWÄHRUNG	VaR und sVaR 2
		ZEITREIHEN GEWINN UND VERLUST	
108	C 108.00	ZEITREIHEN GEWINN UND VERLUST	GuV
		EIGENKAPITALANFORDERUNGEN FÜR ZUSATZRISIKEN (IRC)	
109,1	C 109.01	IRC. ANGABEN ZUM MODELL	IRC 1
109,2	C 109.02	IRC. ANGABEN ZU EINZELNEN PORTFOLIOS	IRC 2
109,3	C 109.03	IRC. BETRAG PRO PORTFOLIO/DATUM	IRC 3
		KORRELATIONSHANDEL (CT)	
110,1	C 110.01	CT. ANGABEN ZUM MODELL	CT 1
110,2	C 110.02	CT. ANGABEN ZU EINZELNEN PORTFOLIOS	CT 2
110,3	C 110.03	CT. BETRAG PRO PORTFOLIO/DATUM	CT 3

C 106.00 — URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG UND GRÜNDE FÜR 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 Nichteinbeziehung	Freies Textfeld	Ursprüngliche Marktbewertung
010	020	030	040	050	060	070

C 107.01 - VaR, sVaR und PV. ANGABEN

		Option	Freies Textfeld
		010	020
Risikopotenzial (VaR)			
010	Verfahren		
020	Liquiditätshorizont		
030	Länge des Beobachtungszeitraums		
040	Datengewichtung		
050	Backtesting-Zuschlagsfaktor		
060	Aufsichtlicher Zuschlagsfaktor		
Risikopotenzial unter Stressbedingungen (sVaR)			
070	Verfahren		
080	Liquiditätshorizont		
090	Aufsichtlicher Zuschlagsfaktor		
100	Zeitfenster Risikopotenzial unter Stressbedingungen		

C 107.02 - VaR und sVaR NICHT-CTP. ERGEBNISSE BASISWÄHRUNG

Portfolio

Datum	Risikopotenzial (VaR)	Risikopotenzial unter Stressbedingungen (sVaR)	PV
010	020	030	040

C 108.00 - ZEITREIHEN GEWINN UND VERLUST

Portfolio

Datum	Tägliche GuV
010	020

C 109.01 - IRC. ANGABEN ZUM MODELL

		Option	Freies Textfeld
Zeile	Posten	010	020
010	Anzahl der Modellierungsfaktoren		
020	Herkunft von LGD (Loss Given Default)		

C 109.02 - IRC. ANGABEN ZU EINZELNEN PORTFOLIOS

Portfolio

		Option	Freies Textfeld
Zeile	Posten	010	020
010	Liquiditätshorizont		
020	Herkunft der Ausfallwahrscheinlichkeiten (PD)		
030	Herkunft der Übergangsmatrizen		

C 109.03 - IRC. BETRAG PRO PORTFOLIO/DATUM

Portfolio

Datum	IRC
010	020

C 110.01 - CT. ANGABEN ZUM MODELL

		Option	Freies Textfeld
Zeile	Posten	010	020
010	Anzahl der Modellierungsfaktoren		
020	Herkunft von LGD (Loss Given Default)		

C 110.02 — CT. ANGABEN ZU EINZELNEN PORTFOLIOS

Portfolio

		Option	Freies Textfeld
Zeile	Posten	010	020
010	Liquiditätshorizont		
020	Herkunft der Ausfallwahrscheinlichkeiten (PD)		
030	Herkunft der Übergangsmatrizen		

C 110.03 - CT. APR PRO PORTFOLIO/DATUM

Portfolio

Datum	All Price Risk (APR)
010	020“