

## „ANHANG VI

**ERGEBNISSE DER AUFSICHTLICHEN REFERENZPORTFOLIOS**

<b>MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN</b> .....	2748
C 106.00 – Ursprüngliche Marktbewertung und Gründe für die Nichteinbeziehung .....	2748
C 107.01 – VaR und sVaR Nicht-CTP. Nähere Angaben .....	2749
C 107.02 – VaR, sVaR und PV – Nicht-CTP. Ergebnisse Basiswährung .....	2752
C 108.00 – Gewinn- und Verlust-Zeitreihen .....	2753
C 109.01 – IRC. Nähere Angaben zum Modell .....	2754
C 109.02 – IRC. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios .....	2755
C 109.03 – IRC. Betrag nach Portfolio/Datum .....	2756
C 110.01 – CT. Nähere Angaben zum Modell .....	2757
C 110.02 – CT. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios .....	2758
C 110.03 – CT. APR nach Portfolio/Datum .....	2759

MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN

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

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
010	Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V.
020	Modellierung des Instruments für VaR und sVaR (JA/NEIN)		Anzugeben ist entweder JA oder NEIN.
030	Modellierung des Instruments für IRC (JA/NEIN)		Anzugeben ist entweder JA oder NEIN.
040	Modellierung des Instruments für Korrelationshandel (JA/NEIN)		Anzugeben ist entweder JA oder NEIN.
050	Grund für die Nichteinbeziehung	Artikel 3 Absatz 2 der Durchführungsverordnung (EU) 2016/2070 der Kommission	Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: 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 060 erläutern.
060	Freitextfeld		In dieser Spalte kann das Institut zusätzliche Angaben machen.
070	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).  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).

**C107.01 - VaR und sVaR Nicht-CTP. Nähere Angaben.**

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
010-060	VaR		
010	Methodik		<p>In Spalte 010 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>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen. Wurde in Spalte 010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 020 nähere Angaben dazu zu machen.</p>
020	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen	Artikel 365 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 010 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 mit Überlappungsperioden;</li> <li>c) 10 Tage, sonstige Methodik.</li> </ul> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen.</p>
030	Länge des Beobachtungszeitraums	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 010 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>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen.</p>

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
040	Datengewichtung	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <p>a) Ungewichtet (VaR-Datengewichtung);</p> <p>b) Gewichtet (VaR-Datengewichtung);</p> <p>c) Jeweils höherer Wert von ‚Ungewichtet‘ nach Buchstabe a und ‚Gewichtet‘ nach Buchstabe b (VaR-Datengewichtung).</p> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen.</p>
050	Backtesting-Zuschlagsfaktor	Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Der Backtesting-Zuschlagsfaktor ist der Zuschlagsfaktor zwischen 0 und 1 aus der Tabelle 1 in Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013.</p> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen.</p>
060	Aufsichtlicher VaR-Zuschlagsfaktor	Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (mindestens 3 <sup>a</sup> )	<p>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.</p> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen.</p>
070-100	SVaR (d. h. VaR unter Stressbedingungen)		
070	Methodik		<p>In Spalte 010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <p>a) Historische Simulation</p> <p>b) Monte-Carlo-Simulation;</p> <p>c) Parametrisch;</p> <p>d) Kombination/Sonstige (bitte angeben).</p> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen. Wurde in Spalte 010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 020 nähere Angaben dazu zu machen.</p>

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
080	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen	Artikel 365 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 010 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 mit Überlappungsperioden;</li> <li>c) 10 Tage, sonstige Methodik.</li> </ul> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen.</p>
090	Aufsichtlicher sVaR-Zuschlagsfaktor	Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Der aufsichtliche Zuschlagsfaktor ist der von der zuständigen Behörde vorgegebene Zuschlagsfaktor auf den s VaR-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).</p> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen.</p>
100	SVaR-Zeitraum	Artikel 365 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 010 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 020 angegebenen Datum;</li> <li>b) wöchentliche Berechnung von sVaR, kalibriert auf einen ununterbrochenen 12-Monats-Zeitraum, beginnend mit dem in Spalte 020 angegebenen Datum;</li> <li>c) tägliche Berechnung von SVaR, kalibriert auf verschiedene ununterbrochene 12-Monats-Zeiträume im Rahmen der in C107.02 Spalte 010 angegebenen VaR-Meldestichtage, beginnend mit den in Spalte 020 angegebenen Daten;</li> <li>d) wöchentliche Berechnung von SVaR, kalibriert auf verschiedene ununterbrochene 12-Monats-Zeiträume im Rahmen der in C107.02 Spalte 010 angegebenen VaR-Meldestichtage, beginnend mit den in Spalte 020 angegebenen Daten;</li> <li>e) Maximum der täglichen Berechnung von SVaR, kalibriert auf mehr als einen durchgehenden 12-Monats-Zeitraum;</li> <li>f) Maximum der wöchentlichen Berechnung von sVaR, kalibriert auf mehr als einen durchgehenden 12-Monats-Zeitraum;</li> <li>g) Sonstige SVaR-Kalibrierung (bitte spezifizieren).</li> </ul> <p>Falls in Spalte 010 Option a oder b gewählt wird, ist in Spalte 020 das Startdatum im Format ‚TT/MM/JJJJ‘ anzugeben. Wird in Spalte 010 die Option c oder d gewählt, sind die Startdaten für jede sVaR-Berechnung im Format ‚TT/MM/JJJJ‘ in Spalte 010 anzugeben. Wird in Spalte 010 Option e, f oder g gewählt, so ist in Spalte 020 auch anzugeben, welcher 12-Monats-Zeitraum für jede sVaR-Berechnung verwendet wird.</p>

## C 107.02 – VaR, sVaR und PV – Nicht-CTP. Ergebnisse Basiswährung

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitt 3 und 4 dieser Durch- führungsverord- nung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
010	Datum		Die Ergebnisse für VaR, sVaR und Barwert (PV) sind für alle 10 Geschäftstage zwischen dem ‚ersten RM-Referenzdatum‘ und dem ‚letzten RM-Referenzdatum‘ (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ‘ zu befolgen.
020	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 010 angegebene Datum ist eine Zahl auszuweisen. Berechnet das Institut keinen VaR-Wert für das in Spalte 010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).
030	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 010 angegebene Datum ist eine Zahl auszuweisen. Berechnet das Institut keinen sVaR-Wert für das in Spalte 010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
040	PV		<p>Angabe des Barwerts (PV) für jedes Portfolio.</p> <p>Für jedes in Spalte 010 angegebene Datum ist eine Zahl auszuweisen. Berechnet das Institut keinen PV für das in Spalte 010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).</p>

### 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 Abschnitt 3 und 4 dieser Durch- führungsverord- nung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Durchführungsverordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
010	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 010 von Meldebogen C107.02 verwendeten GuV-Reihen mit mindestens 250 Beobachtungswerten ab 31. Januar 2020 zurückreichend an.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
020	Tägliche GuV		<p>Institute, die VaR mittels historischer Simulation berechnen, tragen die vollständigen vom Institut verwendeten historischen Datenreihen mit mindestens ein Jahr umfassenden Datenreihen und mit der an jedem Geschäftstag am Portfolio vorgenommenen Bewertungsänderung (d. h. täglicher GuV) ein (d. h. durch Vergleich der an jedem in Spalte 010 gemeldeten Geschäftstag zu Tagesschluss gültigen Bewertung mit der zum vorigen Tagesschluss gültigen Bewertung).</p> <p>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).</p>

### C 109.01 – IRC. Nähere Angaben zum Modell

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
010	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> <p>a) 1 Modellierungsfaktor;  b) 2 Modellierungsfaktoren;  c) Mehr als 2 Modellierungsfaktoren.</p> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen.</p>
020	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> <p>a) Marktkonvention;  b) LGD aus IRB;  c) Sonstige Herkunft der LGD (bitte angeben).</p> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen. Wurde in Spalte 010 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 Abschnitt 3 und 4 dieser Durch- führungsverord- nung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Durchführungsverordnung nur für Portfolios, für die IRC-Berechnungen verlangt werden.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
10	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.
20	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).  Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen. Wurde in Spalte 010 Option d ausgewählt, sind hier in Spalte 020 nähere Angaben dazu zu machen.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
30	Herkunft der Übergangsmatrizen		<p>EBA/GL/2012/3</p> <p>Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten Übergangsmatrizen. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten:</p> <p>a) Ratingagenturen;</p> <p>b) IRB;</p> <p>c) Marktimplizierte Übergangsmatrizen;</p> <p>d) Sonstige Herkunft der Übergangsmatrizen (bitte angeben).</p> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen. Wurde in Spalte 010 Option d ausgewählt, sind hier in Spalte 020 nähere Angaben dazu zu machen.</p>

### C 109.03 – IRC. Betrag nach Portfolio/Datum

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

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

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
010	Datum		IRC ist für alle 10 Geschäftstage zwischen dem ‚ersten RM-Referenzdatum‘ und dem ‚letzten RM-Referenzdatum‘ (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ‘ zu befolgen.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
020	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 010 angegebene Datum ist eine Zahl auszuweisen. Berechnet das Institut keine IRC für das in Spalte 010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind ausschließlich einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich null ergibt).

### C 110.01 – CT. Nähere Angaben zum Modell.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
010	Anzahl der Modellierungsfaktoren	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Anzahl der Modellierungsfaktoren auf der Ebene des Korrelationshandels-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) 1 Modellierungsfaktor; b) 2 Modellierungsfaktoren; c) Mehr als 2 Modellierungsfaktoren. In Spalte 020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 eingetragen werden.
020	Herkunft der LGDs	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Quelle der LGDs auf der Ebene des Korrelationshandels-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Marktkonvention; b) LGD aus IRB; c) Sonstige Herkunft der LGD (bitte angeben). Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen. Wurde in Spalte 010 Option c ausgewählt, sind dazu in dieser Spalte nähere Angaben zu machen.

## C 110.02 – CT. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitt 3 und 4 dieser Durch- führungsverord- nung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Durchführungs- verordnung nur für Portfolios, für die APR-Angaben verlangt werden.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
010	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.
020	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).  Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen. Wurde in Spalte 010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 020 nähere Angaben dazu zu machen.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
030	Herkunft der Übergangsmatrizen	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten Übergangsmatrizen. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten:</p> <p>a) Ratingagenturen;</p> <p>b) IRB;</p> <p>c) Marktimplizierte Übergangsmatrizen;</p> <p>d) Sonstige Herkunft der Übergangsmatrizen (bitte angeben).</p> <p>Nähere Angaben zur Antwort in Spalte 010 sind in Spalte 020 einzutragen. Wurde in Spalte 010 Option d ausgewählt, sind hier in Spalte 020 nähere Angaben dazu zu machen.</p>

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

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

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

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
010	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-Referenzdatum‘ (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ‘ zu befolgen.
60	APR	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Anzugeben sind die Ergebnisse der Anwendung des aufsichtlichen Korrelationshandelsmodells auf jedes Portfolio.</p> <p>Für jedes in Spalte 010 angegebene Datum ist eine Zahl auszuweisen. Verwendet das Institut für das in Spalte 010 angegebene Datum kein Korrelationshandelsmodell, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Berechnungsergebnis tatsächlich gleich null ist).“</p>