

## „ANHANG VII

**Ergebnisse der aufsichtlichen Referenzportfolios. MARKTRISIKO**

<b>ERGEBNISSE DER REFERENZPORTFOLIOS. MARKTRISIKO</b>			
<b>Meldebogen-nummer</b>	<b>Meldebogen-code</b>	<b>Bezeichnung des Meldebogens/der Meldebogengruppe</b>	<b>Kurzbezeichnung</b>
		<b>URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG</b>	
106	C 106.00	URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG	IMV
		<b>VaR, sVaR und PV</b>	
107.1	C 107.01	NÄHERE ANGABEN	VaR und sVaR 1
107.2	C 107.02	ERGEBNISSE BASISWÄHRUNG	VaR und sVaR 2
		<b>GEWINN-UND-VERLUST-ZEITREIHEN</b>	
108	C 108.00	GEWINN-UND-VERLUST-ZEITREIHEN	GuV
		<b>ANSATZ FÜR ZUSÄTZLICHE RISIKEN (INCREMENTAL RISK CHARGE)</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 NACH PORTFOLIO/DATUM	IRC 3
		<b>KORRELATIONSHANDEL</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

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

<b>Nummer des Instruments</b>	<b>Modellierung des Instruments für VaR und sVaR (JA/NEIN)</b>	<b>Modellierung des Instruments für IRC (JA/NEIN)</b>	<b>Modellierung des Instruments für Korrelationshandel (JA/NEIN)</b>	<b>Grund für die Nichteinbeziehung</b>	<b>Freitextfeld</b>	<b>Ursprüngliche Marktbewertung</b>
010	020	030	040	050	060	070

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

		Option	Freitextfeld
		010	020
<b>VaR</b>			
010	Methodik		
020	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen		
030	Länge des Beobachtungszeitraums		
040	Datengewichtung		
050	Backtesting-Zuschlagsfaktor		
060	Aufsichtlicher sVaR-Zuschlagsfaktor		
<b>sVaR</b>			
070	Methodik		
080	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen		
090	Aufsichtlicher sVaR-Zuschlagsfaktor		
100	sVaR-Zeitraum		

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

Portfolio

Datum	VaR	sVaR	PV
010	020	030	040

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

Portfolio

Datum	Tägliche GuV
010	020

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

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	010	020
010	Anzahl der Modellierungsfaktoren		
020	Herkunft der LGDs		

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

Portfolio

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	010	020
010	Liquiditätshorizont		
020	Herkunft der PDs		
030	Herkunft der Übergangsmatrizen		

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

Portfolio

Datum	IRC
010	020

**C 110.01 – KORRELATIONSHANDEL (CT). NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL**

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	010	020
010	Anzahl der Modellierungsfaktoren		
020	Herkunft der LGDs		

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

Portfolio

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	010	020
010	Liquiditätshorizont		
020	Herkunft der PDs		
030	Herkunft der Übergangsmatrizen		

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

Portfolio

Datum	APR
010	020"