

## „ANHANG VI

**ERGEBNISSE DER AUFSICHTLICHEN REFERENZPORTFOLIOS**

<b>ERLÄUTERUNGEN ZU DEN EINZELNEN MELDEBÖGEN</b> .....	2833
C 106.00 – Ursprüngliche Marktbewertung und Gründe für die Nichteinbeziehung .....	2833
C 107.01 - VaR und sVaR Nicht-CTP. Details .....	2834
C 107.02 – VaR, sVaR und PV – Nicht-CTP. Ergebnisse Basiswährung .....	2836
C 108.00 – Gewinn- und Verlust-Zeitreihen .....	2837
C 109.01 – IRC. Nähere Angaben zum Modell .....	2838
C 109.02 – IRC. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios .....	2839
C 109.03 – Eigenkapitalanforderungen für zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiken (IRC). Betrag nach Portfolio/Datum .....	2840
C 110.01 – CT. Nähere Angaben zum Modell. ....	2840
C 110.02 – CT. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios. ....	2841
C 110.03 – CT. APR nach Portfolio/Datum .....	2842

ERLÄUTERUNGEN ZU DEN EINZELNEN MELDEBÖGEN

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

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V.
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	Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus: (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). 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 107.01 - VaR und sVaR Nicht-CTP. Details.**

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010 - 0060	VaR		
0010	Methode		<p>In Spalte 0010 bitte eine der folgenden Möglichkeiten angeben:</p> <p>(a) Historische Simulation                      (b) Monte-Carlo-Simulation;                      (c) Parametrisch;                      (d) Kombination/Sonstige (bitte angeben).</p> <p>Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.</p>
0020	Berechnung des Zeit- horizonts von 10 Ta- gen	Artikel 365 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 0010 bitte eine der folgenden Möglichkeiten angeben:</p> <p>(a) 1 Tag aufskaliert auf 10 Tage;                      (b) 10 Tage mit Überlappungsperioden;                      (c) 10 Tage, sonstige Methode.</p> <p>Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen.</p>
0030	Länge des Beobach- tungszeitraums	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 0010 bitte eine der folgenden Möglichkeiten angeben:</p> <p>(a) bis zu 1 Jahr;                      (b) mehr als 1 Jahr bis zu 2 Jahre;                      (c) mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahre;                      (d) mehr als 3 Jahre.</p> <p>Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen.</p>
0040	Datengewichtung	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 0010 bitte eine der folgenden Möglichkeiten angeben:</p> <p>(a) Ungewichtet (VaR-Datengewichtung);                      (b) Gewichtet (VaR-Datengewichtung);</p>

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			(c) Der höhere Wert von ‚Ungewichtet‘ unter a und ‚Gewichtet‘ unter b (VaR-Datengewichtung). Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen.
0050	Backtesting-Zuschlagsfaktor	Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	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. Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen.
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. Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen.
0070-0100	SVaR (d. h. VaR unter Stressbedingungen)		
0070	Methode		In Spalte 0010 bitte eine der folgenden Möglichkeiten angeben: (a) Historische Simulation (b) Monte-Carlo-Simulation; (c) Parametrisch; (d) Kombination/Sonstige (bitte angeben). Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen. 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 bitte eine der folgenden Möglichkeiten angeben: (a) 1 Tag aufskaliert auf 10 Tage; (b) 10 Tage mit Überlappungsperioden; (c) 10 Tage, sonstige Methode. Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
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). Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen.
0100	SVaR-Zeitraum	Artikel 365 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	In Spalte 0010 bitte eine der folgenden Möglichkeiten angeben: (a) tägliche Berechnung von sVaR, kalibriert auf einen ununterbrochenen 12-Monats-Zeitraum, beginnend mit dem in Spalte 0020 angegebenen Datum; (b) wöchentliche Berechnung von sVaR, kalibriert auf einen ununterbrochenen 12-Monats-Zeitraum, beginnend mit dem in Spalte 0020 angegebenen Datum; (c) tägliche Berechnung von sVaR, kalibriert auf verschiedene ununterbrochene 12-Monats-Zeiträume im Rahmen der in C 107.02 Spalte 0010 angegebenen VaR-Meldestichtage, beginnend mit den in Spalte 0020 angegebenen Daten; (d) wöchentliche Berechnung von sVaR, kalibriert auf verschiedene ununterbrochene 12-Monats-Zeiträume im Rahmen der in C 107.02 Spalte 0010 angegebenen VaR-Meldestichtage, beginnend mit den in Spalte 0020 angegebenen Daten; (e) Maximum der täglichen Berechnung von sVaR, kalibriert auf mehr als einen durchgehenden 12-Monats-Zeitraum; (f) Maximum der wöchentlichen Berechnung von sVaR, kalibriert auf mehr als einen durchgehenden 12-Monats-Zeitraum; (g) Sonstige sVaR-Kalibrierung (bitte näher ausführen). Falls in Spalte 0010 Option a oder b gewählt wird, ist in Spalte 0020 das Startdatum im Format ‚TT/MM/JJJJ‘ anzugeben. Wird in Spalte 0010 die Option c oder d gewählt, sind in Spalte 0020 die Startdaten für jede sVaR-Berechnung im Format ‚TT/MM/JJJJ‘ anzugeben. Wird in Spalte 0010 Option e, f oder g gewählt, so ist in Spalte 0020 auch anzugeben, welcher 12-Monats-Zeitraum für jede sVaR-Berechnung verwendet wird.

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

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

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

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-Referenzdatum‘ (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b) 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, der für jedes Portfolio ohne Anwendung des aufsichtlichen Multiplikationsfaktors von ‚mindestens 3‘ ermittelt wurde.  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, der für jedes Portfolio ohne Anwendung des aufsichtlichen Multiplikationsfaktors von ‚mindestens 3‘ ermittelt wurde.  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 Barwert 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 Durchführungsverordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Durchführungsverordnung.

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 29. Januar 2021 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 an jedem Geschäftstag am Portfolio vorgenommenen Bewertungsänderung (d. h. täglicher GuV) ein (d. h. durch Vergleich der an jedem in Spalte 0010 gemeldeten Geschäftstag zu Tagesschluss gültigen Bewertung mit der zum vorigen Tagesschluss gültigen Bewertung).  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		EBA/GL/2012/3  Angabe der Anzahl der Modellierungsfaktoren auf Ebene des IRC-Modells insgesamt. Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus:  (a) 1 Modellierungsfaktor;  (b) 2 Modellierungsfaktoren;  (c) Mehr als 2 Modellierungsfaktoren.  Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen.
0020	Herkunft der LGDs		EBA/GL/2012/3  Angabe der Herkunft der LGDs auf Ebene des IRC-Modells insgesamt. Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus:  (a) Marktkonvention;  (b) LGD aus IRB;  (c) Sonstige Herkunft der LGD (bitte angeben).  Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen. Wurde in Spalte 0010 Option c ausgewählt, sind dazu hier nähere Angaben zu machen.

## 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 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.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Liquiditätshorizont	Artikel 374 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Angabe des auf Portfolioebene verwendeten Liquiditätshorizonts. Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus: (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. Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus: (a) Ratingagenturen; (b) IRB; (c) Marktimplizierte PDs; (d) Sonstige Herkunft der PDs (bitte angeben). Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen. 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. Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus: (a) Ratingagenturen;



Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			(b) IRB; (c) Marktimplizierte Übergangsmatrizen; (d) Sonstige Herkunft der Übergangsmatrizen (bitte angeben). Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind hier in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.

### C 109.03 — Eigenkapitalanforderungen für zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiken (IRC). Betrag nach Portfolio/Datum

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 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
0010	Datum		Die 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.
0020	IRC	Artikel 372 bis 376 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Angabe des aufsichtsrechtlich vorgeschriebenen 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 ausschließlich einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich null ergibt).

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

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Anzahl der Modellierungsfaktoren	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Anzahl der Modellierungsfaktoren auf der Ebene des Korrelationshandelsmodells insgesamt. Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus: (a) 1 Modellierungsfaktor; (b) 2 Modellierungsfaktoren;

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			(c) Mehr als 2 Modellierungsfaktoren. Möchte das Institut nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 machen, bitte hierfür Spalte 0020 nutzen.
0020	Herkunft der LGDs	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Herkunft der LGDs auf Ebene des Korrelationshandelsmodells insgesamt. Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus: (a) Marktkonvention; (b) LGD aus IRB; (c) Sonstige Herkunft der LGD (bitte angeben). Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen. Wurde in Spalte 0010 Option c ausgewählt, sind dazu hier 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 Abschnitte 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 APR-Berechnungen verlangt werden.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Liquiditätshorizont	Artikel 377 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe des auf Portfolioebene verwendeten Liquiditätshorizonts. Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus: (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. Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus: (a) Ratingagenturen; (b) IRB;

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			<p>(c) Marktimplizierte PDs;</p> <p>(d) Sonstige Herkunft der PDs (bitte angeben).</p> <p>Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.</p>
0030	Herkunft der Übergangsmatrizen	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten Übergangsmatrizen. Bitte wählen Sie aus folgender Liste eine Antwort aus:</p> <p>(a) Ratingagenturen;</p> <p>(b) IRB;</p> <p>(c) Marktimplizierte Übergangsmatrizen;</p> <p>(d) Sonstige Herkunft der Übergangsmatrizen (bitte angeben).</p> <p>Für nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 bitte Spalte 0020 nutzen. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 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 Abschnitte 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 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-Referenzdatum‘ (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ‘ 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).“