

„ANHANG VII

Ergebnisse der Aufsichtlichen Referenzportfolios MARKTRISIKO

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

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 die IRC (JA/NEIN)	Modellierung des Instruments für den Korrelationshandel (JA/NEIN)	Grund für die Nichteinbeziehung	Freitextfeld	Ursprüngliche Marktbewertung
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 107.01 - VaR, sVaR und PV. NÄHERE ANGABEN

		Option	Freitextfeld
		0010	0020
VaR			
0010	Methode		
0020	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen		
0030	Länge des Beobachtungszeitraums		
0040	Datengewichtung		
0050	Backtesting-Zuschlagsfaktor		
0060	Aufsichtlicher Zuschlagsfaktor		
Risikopotenzial unter Stressbedingungen (sVaR)			
0070	Methode		
0080	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen		
0090	Aufsichtlicher sVaR-Zuschlagsfaktor		
0100	sVaR-Zeitraum		

C 107.02 - VaR und sVaR KEIN CTP. ERGEBNISSE BASISWÄHRUNG

Portfolio

Datum	VaR	sVaR	PV
0010	0020	0030	0040

C 108.00 - GEWINN- UND VERLUST-ZEITREIHEN

Portfolio

Datum	GuV - Tageswerte
0010	0020

C 109.01 – IRC. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL

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

C 109.02 – IRC. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS

Portfolio

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

C 110.02 – CT. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS

Portfolio

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

C 110.03 – CT. ALL PRICE RISK (APR) PRO PORTFOLIO/DATUM

Portfolio

Datum	APR
0010	0060"