

„ANHANG VI

ERGEBNISSE DER AUFSICHTLICHEN REFERENZPORTFOLIOS

MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN	2839
C 106.00 – Ursprüngliche Marktbewertung und Gründe für die Nichteinbeziehung	2839
C 106.01 – SBM Risikosensitivitäten nach Instrument	2840
C 107.01 – VaR und sVaR Nicht-CTP Weitere Angaben.	2843
C 107.02 – VaR, sVaR und PV – Nicht-CTP. Ergebnisse Basiswährung	2845
C 108.00 – Gewinn- und Verlust-Zeitreihen	2846
C 109.01 – IRC. Angaben zum Modell	2847
C 109.02 – IRC. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios	2848
C 109.03 – IRC. Betrag nach Portfolio/Datum	2849
C 110.01 – CT. Nähere Angaben zum Modell.	2849
C 110.02 – CT. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios	2850
C 110.03 – CT. APR nach Portfolio/Datum	2851
C 120.01 – SBM Risikosensitivitäten nach Instrument/Portfolio	2852
C 120.02 – SBM. OFR-Zusammensetzung nach Portfolio	2854
C 120.03 – SBM. OFR	2855

MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN

C 106.00 – Ursprüngliche Marktbewertung und Gründe für die Nichteinbeziehung

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung	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	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 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 106.01 — SBM Risikosensitivitäten nach Instrument

Hier melden die Institute die Sensitivitäten gegenüber den Risikofaktoren, denen das Instrument ausgesetzt ist. Dabei ist ein Risikofaktor/eine Sensitivität pro Zeile anzugeben. Die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition des betreffenden Risikofaktors (CVRk+) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk-) im Sinne von Artikel 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 sind in einzelnen Zeilen zu melden. Alle Werte sind auf das ‚IMV-Referenzdatum‘ (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b zu beziehen). Die Institute dürfen jede Kombination aus Instrumentennummer, Risikokennung (Spalte 0010), Unterklasse (Spalte 0020) und Zusätzlicher Kennung (Spalte 0030) nur einmal melden.

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Risikofaktor-Kennung	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben ist die einschlägige Risikofaktor-Kennung aus der Tabelle am Ende dieses Anhangs.
0020	Unterklasse	Artikel 325d Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Hier ist die Unterklasse auszuweisen, je nachdem, welcher Risikoklasse die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung entspricht:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Allgemeines Zinsrisiko – anzugeben ist die Währung des Risikofaktors maßgebliche risikofreie Zinssätze, Inflationsrisiko oder Basis-Währungsrisiko (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR‘); — Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen – anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ah Absatz 1 Tabelle 4. — Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR außerhalb des alternativen Korrelationshandelsportfolios) – anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325am Absatz 1 Tabelle 7. — Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR des alternativen Korrelationshandelsportfolios) – anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ak Tabelle 6. — Aktienkursrisiko – anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ap Absatz 1 Tabelle 8. — Warenpositionsrisiko – anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325as Tabelle 9. — Fremdwährungsrisiko und Komponenten Delta oder Krümmung – anzugeben ist die Währung (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚USD‘). — Fremdwährungsrisiko und Komponente Vega – anzugeben ist das Währungspaar (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR_USD‘).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0030	Zusätzliche Kennung	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Um den Risikofaktor innerhalb der Unterklasse genauer zu kennzeichnen, werden die nachstehend ausgeführten Angaben gemeldet. Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse</p> <ul style="list-style-type: none"> — ‚allgemeines Zinsrisiko‘ und Delta-Komponente und entspricht der Risikofaktor einem risikolosen Zinssatz, so ist die Bezeichnung der risikofreien Kurve oder eine andere entsprechende eindeutige Kennung anzugeben; — Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen oder der Risikoklasse Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR des alternativen Korrelationshandelsportfolios), so ist der Name des Emittenten oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben; — Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR außerhalb des alternativen Korrelationshandelsportfolios), so ist die Bezeichnung der Tranche oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben; — Aktienkursrisiko, so ist die Aktienemittenten-Adresse oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben; — Warenpositionsrisiko, so ist die Bezeichnung der Ware oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben. <p>Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist ‚N.A.‘ anzugeben.</p>
0040	Implizite Volatilität	Artikel 325g und 325ax Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Zur genaueren Kennzeichnung des Risikofaktors werden die nachstehend ausgeführten Angaben gemeldet:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Entspricht die in Spalte 0010 ausgewiesene Risikofaktor-Kennung der Vega-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so wird der Wert des Risikofaktors k (implizite Volatilität) angegeben, der zur Berechnung des Risikogewichts für einen bestimmten Vega-Risikofaktor k (RW_k) im Sinne von Artikel 325ax Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 verwendet wird. <p>Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist das Feld leer zu lassen.</p>
0050	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325r, 325s sowie 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Die Risikosensitivitäten (Delta/Vega-Sensitivitäten und Krümmungsrisikopositionen) sind für alle in den Spalten 0010 bis 0030 genannten relevanten Risikofaktoren auf der Ebene des einzelnen Instruments anzugeben. Für die Angaben dieser Werte ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts zu verwenden. Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung</p> <ul style="list-style-type: none"> — der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Netto-Sensitivität gegenüber dem Risikofaktor (S_k) im Sinne von Artikel 325r der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben; — der Vega-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Vega-Risikosensitivität eine Option gegenüber einem gegebenen Risikofaktor (S_k) im Sinne von Artikel 325s der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben;

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			<p>— der Krümmungsrisikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVR_k^+) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVR_k^-) im Sinne von Artikel 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben.</p> <p>Nullwerte sind nur dann anzugeben, wenn die Berechnung tatsächlich null ergibt.</p>
0060	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR‘).
0070	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung des EBA-Instruments)	Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung und Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325r, 325s und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0060 anzugeben, allerdings umgerechnet zum Kassakurs für die Währung des Instruments im Sinne von Anhang V Abschnitt 2.
0080	Bewertungsmodell	Artikel 325t der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Hier gibt das Institut an, aus welchem Bewertungsmodell die Sensitivitäten abgeleitet werden. Auszuwählen ist eine der folgenden Möglichkeiten:</p> <p>a) ‚Bewertungsmodelle des Instituts, die als Grundlage für die Meldung von Gewinnen und Verlusten an das höhere Management dienen‘ (im Sinne von Artikel 325t Absatz 1 Unterabsatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013);</p> <p>b) ‚Auf internen Modellen des Instituts basierender Ansatz‘ (im Sinne von Artikel 325 t Absatz 1 Unterabsatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013).</p>
0090	Definition der Sensitivitäten	Artikel 325r, 325s und 325t der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Das Institut gibt an, welche Definition der Sensitivitäten bei der Berechnung der Eigenmittelanforderungen zugrunde gelegt wird. Auszuwählen ist eine der folgenden Möglichkeiten:</p> <p>a) Definition der Sensitivitäten nach den Artikeln 325r und 325s der Verordnung (EU) Nr. 575/2013;</p> <p>b) Definition der Sensitivitäten nach Artikel 325t Absätze 5 und 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013.</p>
0100	Freitextfeld		In dieser Spalte können zusätzliche Angaben zum Bewertungsmodell und zur Definition der Sensitivitäten gemacht werden.

C 107.01 – VaR und sVaR Nicht-CTP Weitere Angaben.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010-0060	VaR		
0010	Methodik		<p>In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) Historische Simulation; b) Monte-Carlo-Simulation; c) Parametrisch; d) Kombination/Sonstige (bitte angeben). <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. 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 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) 1 Tag aufskaliert auf 10 Tage; b) 10 Tage ohne Überlappungsperioden; c) 10 Tage, sonstige Methodik. <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.</p>
0030	Länge des Beobach- tungszeit-raums	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verord- nung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) bis zu 1 Jahr; b) mehr als 1 Jahr, bis zu 2 Jahre; c) mehr als 2 Jahr, bis zu 3 Jahre; d) mehr als 3 Jahre. <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.</p>
0040	Datengewichtung	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verord- nung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) Ungewichtet (VaR-Datengewichtung); b) Gewichtet (VaR-Datengewichtung); c) Jeweils höherer Wert von ‚Ungewichtet‘ unter a und ‚Gewichtet‘ unter b (VaR-Datengewichtung). <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.</p>

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
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. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
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. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0070-0100	SVaR (d. h. VaR unter Stressbedingungen)		
0070	Methodik		In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) Historische Simulation; b) Monte-Carlo-Simulation; c) Parametrisch; d) Kombination/Sonstige (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. 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 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) 1 Tag aufskaliert auf 10 Tage; b) 10 Tage ohne Überlappungsperioden; c) 10 Tage, sonstige Methodik. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
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). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0100	sVaR-Zeitraum	Artikel 365 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen:</p> <ul style="list-style-type: none"> 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 C107.02 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 C107.02 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 für die wöchentliche Berechnung des Risikopotenzials unter Stressbedingungen, kalibriert auf mehr als einen ununterbrochenen Zeitraum von 12 Monaten; g) Sonstige SVaR-Kalibrierung (bitte spezifizieren). <p>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 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.</p>

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 Verordnung	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 (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 für jedes Portfolio, ohne Anwendung des aufsichtlichen Multiplikationsfaktors von ‚mindestens 3‘. 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 für jedes Portfolio, ohne Anwendung des aufsichtlichen Multiplikationsfaktors von ‚mindestens 3‘. 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 PV 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 Verordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Verordnung.

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 C107.02 verwendeten GuV-Reihen mit mindestens 250 Beobachtungswerten ab 28. Januar 2022 zurückreichend an.
0020	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. tägliche 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).</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. Angaben zum Modell

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	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> <ul style="list-style-type: none"> a) 1 Modellierungsfaktor; b) 2 Modellierungsfaktoren; c) Mehr als 2 Modellierungsfaktoren. <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.</p>
0020	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> <ul style="list-style-type: none"> a) Marktkonvention; b) LGD aus IRB; c) Sonstige Herkunft der LGD (bitte angeben). <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 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 Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Verordnung 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 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.
0020	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). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. 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. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Ratingagenturen; b) IRB; c) Marktimplizierte Übergangsmatrizen;

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			d) Sonstige Herkunft der Übergangsmatrizen (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind hier in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.

C 109.03 – IRC. Betrag nach Portfolio/Datum

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

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

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	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.
0020	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 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 nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).

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 Korrelationshandels-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) 1 Modellierungsfaktor; b) 2 Modellierungsfaktoren; c) Mehr als 2 Modellierungsfaktoren. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0020	Herkunft der LGDs	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Angabe der Herkunft der LGDs auf der Ebene des Korrelationshandels-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten:</p> <p>a) Marktkonvention;</p> <p>b) LGD aus IRB;</p> <p>c) Sonstige Herkunft der LGD (bitte angeben).</p> <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option c ausgewählt, sind dazu in dieser Spalte nähere Angaben zu machen.</p>

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 Verordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Verordnung 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	<p>Angabe des auf Portfolioebene angewandten Liquiditätshorizonts. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten:</p> <p>a) Bis zu 3 Monate;</p> <p>b) Mehr als 3 bis zu 6 Monate;</p> <p>c) Mehr als 6 bis zu 9 Monate;</p> <p>d) Mehr als 9 bis zu 12 Monate.</p>
0020	Herkunft der PDs	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten PDs. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten:</p> <p>a) Ratingagenturen;</p> <p>b) IRB;</p> <p>c) Marktimplizierte PDs;</p> <p>d) Sonstige Herkunft der PDs (bitte angeben).</p> <p>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.</p>

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0030	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>In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. 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 Verordnung	Angabe der Portfolionummer (sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios) aus Anhang V dieser Verordnung 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 dieser Verordnung) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ‘ zu befolgen.
0060	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 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).</p>

C 120.01 — SBM Risikosensitivitäten nach Instrument/Portfolio

Hier melden die Institute – Instrument für Instrument – die Sensitivitäten gegenüber den Risikofaktoren, denen das Instrument ausgesetzt ist. Dabei ist ein Risikofaktor/eine Sensitivität pro Zeile anzugeben. Die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition des betreffenden Risikofaktors (CVRk+) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk-) im Sinne von Artikel 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 sind in eigenen Zeilen zu melden. Alle Werte sind auf das ‚letzte RM-Referenzdatum‘ (wie in Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung definiert) zu beziehen. Die Institute dürfen jede Kombination aus Portfolio, Instrumentennummer (Spalte 0010), Risikokennung (Spalte 0020), Unterklasse (Spalte 0030) und Zusätzlicher Kennung (Spalte 0040) nur einmal melden.

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des einzelnen und aggregierten Portfolios aus Anhang V dieser Durchführungsverordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V dieser Verordnung.
0020	Risikofaktor-Kennung	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben ist die einschlägige Risikofaktor-Kennung aus der Tabelle am Ende dieses Anhangs.
0030	Unterklasse	Artikel 325d Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Hier ist die Unterklasse auszuweisen, je nachdem, welcher Risikoklasse die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktor-Kennung entspricht:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Allgemeines Zinsrisiko. Anzugeben ist die Währung des Risikofaktors maßgebliche risikofreie Zinssätze, Inflationsrisiko oder Basis-Währungsrisiko (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR‘). — Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen. Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ah Absatz 1 Tabelle 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. — Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR außerhalb des alternativen Korrelationshandelsportfolios). Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325am Absatz 1 Tabelle 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. — Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR des alternativen Korrelationshandelsportfolios). Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ak Tabelle 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. — Aktienkursrisiko. Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ap Absatz 1 Tabelle 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. — Warenpositionsrisiko. Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325as Tabelle 9 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. — Fremdwährungsrisiko und Komponenten Delta oder Krümmung. Anzugeben ist die Währung (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚USD‘). — Fremdwährungsrisiko und Komponente Vega. Anzugeben ist das Währungspaar (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR_USD‘).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0040	Zusätzliche Kennung	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Um den Risikofaktor innerhalb der Unterklasse genauer zu kennzeichnen, werden die nachstehend ausgeführten Angaben gemeldet. Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse</p> <ul style="list-style-type: none"> — ‚allgemeines Zinsrisiko‘ und Delta-Komponente und entspricht der Risikofaktor einem risikolosen Zinssatz, so ist die Bezeichnung der risikofreien Kurve oder eine andere entsprechende eindeutige Kennung anzugeben; — Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen oder der Risikoklasse Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR des alternativen Korrelationshandelsportfolios), so ist der Name des Emittenten oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben; — Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR außerhalb des alternativen Korrelationshandelsportfolios), so ist die Bezeichnung der Tranche oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben; — Aktienkursrisiko, so ist die Aktienemittenten-Adresse oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben; — Warenpositionsrisiko, so ist die Bezeichnung der Ware oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben. <p>Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist ‚N.A.‘ anzugeben.</p>
0050	Implizite Volatilität	Artikel 325g und 325ax Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Zur genaueren Kennzeichnung des Risikofaktors werden die nachstehend ausgeführten Angaben gemeldet:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikofaktor-Kennung der Vega-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so wird der Wert des Risikofaktors k (implizite Volatilität) angegeben, der zur Berechnung des Risikogewichts für einen bestimmten Vega-Risikofaktor k (RW_k) im Sinne von Artikel 325ax Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 verwendet wird. <p>Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist das Feld leer zu lassen.</p>
0060	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325r, 325s sowie 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	<p>Die Risikosensitivitäten (Delta/Vega-Sensitivitäten und Krümmungsrisikopositionen) sind für alle in den Spalten 0020 bis 0040 genannten relevanten Risikofaktoren auf der Ebene des einzelnen Instruments anzugeben. Für die Angaben dieser Werte ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts zu verwenden. Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktor-Kennung</p> <ul style="list-style-type: none"> — der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Netto-Sensitivität gegenüber dem Risikofaktor (S_k) im Sinne von Artikel 325r der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben; — der Vega-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Vega-Risikosensitivität eine Option gegenüber einem gegebenen Risikofaktor (S_k) im Sinne von Artikel 325s der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben;

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			— der Krümmungsrisikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVR_k^+) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVR_k^-) im Sinne von Artikel 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben. Nullwerte sind nur dann anzugeben, wenn die Berechnung tatsächlich null ergibt.
0070	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR‘).
0080	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung und Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325r, 325s sowie 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0060 anzugeben, allerdings umgerechnet zum Kassakurs für die Währung des Portfolios im Sinne von Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung.

C 120.02 — SBM. OFR-Zusammensetzung nach Portfolio

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des einzelnen und aggregierten Portfolios aus Anhang V dieser Verordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Risikoklasse	Artikel 325d Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Risikoklasse. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) ‚Allgemeines Zinsrisiko (GIRR)‘; b) ‚Kreditspread-Risiko. CSR bei Nicht-Verbriefungspositionen‘ (Kreditspread-Risiko (CSR) bei Nicht-Verbriefungspositionen); c) ‚Kreditspread-Risiko. CSR bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘ (CSR außerhalb des alternativen Korrelationshandelsportfolios); d) ‚Kreditspread-Risiko. CSR bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘ (CSR des alternativen Korrelationshandelsportfolios); e) ‚Aktienkursrisiko‘; f) ‚Warenpositionsrisiko‘; g) ‚Fremdwährungsrisiko‘.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0020	Komponente	Artikel 325e Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Komponente der sensitivitätsgestützten Methode. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) ‚Delta-Risiko‘; b) ‚Vega-Risiko‘; c) ‚Krümmungsrisiko‘.
0030	Korrelations-szenario	Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe des Korrelationsszenarios. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Szenario ‚mittlere Korrelation‘; b) Szenario ‚hohe Korrelation‘; c) Szenario ‚niedrige Korrelation‘.
0040	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in Währung der Rechnungslegung)	Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte für die Eigenmittelanforderungen sind für jedes Portfolio für alle relevanten Kombinationen aus Risikoklasse, Komponente und Korrelationsszenario für das ‚letzte RM-Referenzdatum‘ (gemäß Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben. Für die Angaben dieser Werte ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts zu verwenden.
0050	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217).
0060	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung und Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0040 anzugeben, allerdings umgerechnet zum Kassakurs für die Währung des Portfolios im Sinne von Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung.

C 120.03 — SBM. OFR

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Portfolionummer	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung	Angabe der Nummer des einzelnen und aggregierten Portfolios aus Anhang V dieser Verordnung.
0020	SBM OFR (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung und Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderungen für die sensitivitätsgestützte Methode des alternativen Standardansatzes sind für jedes Portfolio für das ‚letzte RM-Referenzdatum‘ (gemäß Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben. Sind die Währungen der Rechnungslegung des Instituts nicht mit den in Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung genannten Währungen identisch, rechnen die Institute die Währungen der Rechnungslegung zum Devisenkassakurs der Währung des Portfolios um.

Tabelle: Hinweise zum Ausfüllen der Meldebögen 106.01 (Spalte 0010) und 120.01 (Spalte 0020)

- Die Spalte ‚Risikoklasse‘ bezieht sich auf Artikel 325d Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Für die Risikoklassen werden die folgenden Abkürzungen verwendet:
- ‚GIRR‘ (allgemeines Zinsrisiko);
 - ‚CSR_NON_SEC‘ (Kreditspreadrisiko (CSR) bei Nicht-Verbriefungspositionen);
 - ‚CSR_SEC_NON_ACTP‘ (Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR außerhalb des alternativen Korrelationshandelsportfolios));
 - ‚CSR_SEC_ACTP‘ (Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR des alternativen Korrelationshandelsportfolios));
 - ‚EQ‘ (Aktienkursrisiko);
 - ‚CM‘ (Warenpositionsrisiko);
 - ‚FX‘ (Fremdwährungsrisiko).
- Die Spalte ‚Komponente‘ bezieht sich auf Artikel 325e Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Für die Komponenten der sensitivitätsgestützten Methode werden die folgenden Abkürzungen verwendet:
- ‚DELTA‘ (Delta-Risiko);
 - ‚VEGA‘ (Vega-Risiko);
 - ‚CURVATURE‘ (Krümmungsrisiko).
- Die Spalte ‚Laufzeit‘ bezieht sich auf die Laufzeit des Risikofaktors, wobei die Risikofaktoren nach den Artikeln 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anhand spezifizierter Punkte definiert werden. Bei Vega-Risikofaktoren des allgemeinen Zinsrisikos im Sinne von Artikel 325l Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 sind zwei Laufzeiten mit Trennstrich anzugeben (z. B. ‚0,5 Jahre – 0,5 Jahre‘), wobei die erste Angabe der Laufzeit der Option und die zweite der Restlaufzeit des Basiswerts der Option zum Ablaufdatum der Option entspricht.
- In der Spalte ‚Zusätzliche Angaben‘ sind genauere Angaben zum jeweiligen Risikofaktor einzutragen mit Blick auf die Unterscheidung zwischen Risikofaktoren des Inflationsrisikos und des Basis-Währungsrisikos im Sinne von Artikel 325 l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, zwischen Risikofaktoren bei Schuldtiteln und bei Kreditausfallswaps im Sinne von Artikel 325m und 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, zwischen Risikofaktoren des Eigenkapital-Kassakurses und des Eigenkapital-Reposatzes im Sinne von Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 und zwischen der Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk+) und der Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk-) im Sinne von Artikel 325 g.

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CM	DELTA	0 Jahre		CM_D_0.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	0,25 Jahre		CM_D_0.25	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	0,5 Jahre		CM_D_0.50	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	1 Jahr		CM_D_1.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	2 Jahre		CM_D_2.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CM	DELTA	3 Jahre		CM_D_3.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	5 Jahre		CM_D_5.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	10 Jahre		CM_D_10.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	15 Jahre		CM_D_15.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	20 Jahre		CM_D_20.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	30 Jahre		CM_D_30.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	0,5 Jahre		CM_V_0.50	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	1 Jahr		CM_V_1.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	3 Jahre		CM_V_3.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	5 Jahre		CM_V_5.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	10 Jahre		CM_V_10.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	CM_CU	Artikel 325p und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	CM_CD	Artikel 325p und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 Jahre	Schuldtitle	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 Jahr	Schuldtitle	CSR_NON_SEC_D_1.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 Jahre	Schuldtitle	CSR_NON_SEC_D_3.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 Jahre	Schuldtitle	CSR_NON_SEC_D_5.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 Jahre	Schuldtitle	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CSR_NON_SEC	DELTA	1 Jahr	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_5.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 Jahre		CSR_NON_SEC_V_0.50	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	1 Jahr		CSR_NON_SEC_V_1.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	3 Jahre		CSR_NON_SEC_V_3.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	5 Jahre		CSR_NON_SEC_V_5.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	10 Jahre		CSR_NON_SEC_V_10.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE	0,5 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CU_0.50	Artikel 325m und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE	1 Jahr	Aufwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CU_1.00	Artikel 325m und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE	3 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CU_3.00	Artikel 325m und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE	5 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CU_5.00	Artikel 325m und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE	10 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CU_10.00	Artikel 325m und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE	0,5 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CD_0.50	Artikel 325m und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CSR_NON_SEC	CURVATURE	1 Jahr	Abwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CD_1.00	Artikel 325m und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE	3 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CD_3.00	Artikel 325m und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE	5 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CD_5.00	Artikel 325m und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE	10 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CD_10.00	Artikel 325m und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_ACTP_D_0.50_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 Jahr	Schuldtitle	CSR_SEC_ACTP_D_1.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_ACTP_D_3.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_ACTP_D_5.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_0.50_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 Jahr	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_1.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_3.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_5.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_0.50	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 Jahr		CSR_SEC_ACTP_V_1.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_3.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_5.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE	0,5 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CU_0.50	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE	1 Jahr	Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CU_1.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE	3 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CU_3.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE	5 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CU_5.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE	10 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CU_10.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE	0,5 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CD_0.50	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE	1 Jahr	Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CD_1.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE	3 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CD_3.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE	5 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CD_5.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE	10 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CD_10.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_NON_ACTP_D_0.50_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	1 Jahr	Schuldtitle	CSR_SEC_NON_ACTP_D_1.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	3 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_NON_ACTP_D_3.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	5 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_NON_ACTP_D_5.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	10 Jahre	Schuldtitle	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_0.50_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	1 Jahr	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_1.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	3 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_3.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_5.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	10 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	0,5 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_0.50	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	1 Jahr		CSR_SEC_NON_ACTP_V_1.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	3 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_3.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	5 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_5.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	10 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE	0,5 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CU_0.50	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE	1 Jahr	Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CU_1.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE	3 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CU_3.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE	5 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CU_5.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE	10 Jahre	Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CU_10.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE	0,5 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CD_0.50	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE	1 Jahr	Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CD_1.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE	3 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CD_3.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE	5 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CD_5.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE	10 Jahre	Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CD_10.00	Artikel 325n und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	DELTA		Kassakurs	EQ_D_SPOT	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	DELTA		Reposatz	EQ_D_REPO	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	0,5 Jahre		EQ_V_0.50	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	1 Jahr		EQ_V_1.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	3 Jahre		EQ_V_3.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	5 Jahre		EQ_V_5.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	10 Jahre		EQ_V_10.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
EQ	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	EQ_CU	Artikel 325o und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	EQ_CD	Artikel 325o und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	DELTA			FX_D	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	0,5 Jahre		FX_V_0.50	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	1 Jahr		FX_V_1.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	3 Jahre		FX_V_3.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	5 Jahre		FX_V_5.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	10 Jahre		FX_V_10.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	FX_CU	Artikel 325q und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	FX_CD	Artikel 325q und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	0,25 Jahre		GIRR_D_0.25	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	0,5 Jahre		GIRR_D_0.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	1 Jahr		GIRR_D_1.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	2 Jahre		GIRR_D_2.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	3 Jahre		GIRR_D_3.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	5 Jahre		GIRR_D_5.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	10 Jahre		GIRR_D_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	15 Jahre		GIRR_D_15.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	20 Jahre		GIRR_D_20.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	30 Jahre		GIRR_D_30.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
GIRR	DELTA		Inflation	GIRR_D_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_D_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_D_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre – 0,5 Jahre		GIRR_V_0.50_0.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr – 0,5 Jahre		GIRR_V_1.00_0.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre – 0,5 Jahre		GIRR_V_3.00_0.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre – 0,5 Jahre		GIRR_V_5.00_0.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre – 0,5 Jahre		GIRR_V_10.00_0.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre – 1 Jahr		GIRR_V_0.50_1.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr – 1 Jahr		GIRR_V_1.00_1.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre – 1 Jahr		GIRR_V_3.00_1.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre – 1 Jahr		GIRR_V_5.00_1.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre – 1 Jahr		GIRR_V_10.00_1.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre – 3 Jahre		GIRR_V_0.50_3.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr – 3 Jahre		GIRR_V_1.00_3.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre – 3 Jahre		GIRR_V_3.00_3.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
GIRR	VEGA	5 Jahre – 3 Jahre		GIRR_V_5.00_3.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre – 3 Jahre		GIRR_V_10.00_3.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre – 5 Jahre		GIRR_V_0.50_5.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr – 5 Jahre		GIRR_V_1.00_5.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre – 5 Jahre		GIRR_V_3.00_5.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre – 5 Jahre		GIRR_V_5.00_5.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre – 5 Jahre		GIRR_V_10.00_5.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre – 10 Jahre		GIRR_V_0.50_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr – 10 Jahre		GIRR_V_1.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre – 10 Jahre		GIRR_V_3.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre – 10 Jahre		GIRR_V_5.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre – 10 Jahre		GIRR_V_10.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre	Inflation	GIRR_V_0.50_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr	Inflation	GIRR_V_1.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre	Inflation	GIRR_V_3.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre	Inflation	GIRR_V_5.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre	Inflation	GIRR_V_10.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_0.50_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
GIRR	VEGA	1 Jahr	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_1.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_3.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_5.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_0.50_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_1.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_3.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_5.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	GIRR_CU	Artikel 325l und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	GIRR_CD	Artikel 325l und 325 g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013“