

## „ANHANG VII

## Ergebnisse der aufsichtlichen Referenzportfolios. MARKTRISIKO

ERGEBNISSE DER REFERENZPORTFOLIOS. MARKTRISIKO			
Melde-bogen-nummer	Melde-bogen-code	Bezeichnung des Meldebogens/der Meldebogengruppe	Kurzbezeichnung
		<b>URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG</b>	
106.1	C 106.00	URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG UND GRÜNDE FÜR DIE NICHT EINBEZIEHUNG	IMV
106.2	C 106.01	RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT	SENSITIVITÄTEN
		<b>VaR, sVaR und PV</b>	
107.1	C 107.01	NÄHERE ANGABEN	VaR&sVaR 1
107.2	C 107.02	ERGEBNISSE BASISWÄHRUNG	VaR&sVaR 2
		<b>GEWINN- UND VERLUST-ZEITREIHEN</b>	
108	C 108.00	GEWINN- UND VERLUST-ZEITREIHEN	GuV
		<b>EIGENKAPITALANFORDERUNGEN FÜR ZUSÄTZLICHE RISIKEN (IRC)</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 PRO PORTFOLIO/DATUM	IRC 3
		<b>KORRELATIONSHANDEL (CT)</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
		<b>SENSITIVITÄTSGESTÜTZTE METHODE (SBM)</b>	
111.1	C 120.01	SBM. SENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO	SBM 1
111.2	C 120.02	SBM. OFR-Zusammensetzung nach Portfolio	SBM 2
111.3	C 120.03	SBM. OFR	SBM 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 IRC (Ja/Nein)	Modellierung des Instruments für Korrelationshandel (Ja/Nein)	Grund für die Nichteinbeziehung	Freitextfeld	Ursprüngliche Marktbewertung
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

**C 106.01 – RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT**

Nummer des Instruments

Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Implizite Volatilität	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Währung der Rechnungslegung	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)	Bewertungsmodell	Definition der Sensitivitäten	Freitextfeld
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100

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

		Option	Freitextfeld
		0010	0020
<b>VaR</b>			
0010	Methodik		
0020	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen		
0030	Länge des Beobachtungszeitraums		
0040	Datengewichtung		
0050	Backtesting-Zuschlagsfaktor		
0060	Aufsichtlicher Zuschlagsfaktor		
<b>sVaR</b>			
0070	Methodik		
0080	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen		
0090	Aufsichtlicher sVaR-Zuschlagsfaktor		
0100	sVaR-Zeitraum		

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

Portfolio

Datum	VaR	sVaR	PV
0010	0020	0030	0040

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

Portfolio

Datum	Tägliche GuV
0010	0020

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

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

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

Portfolio

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	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 120.02 — SBM. OFR-Zusammensetzung nach Portfolio**

Portfolio

Risikoklasse	Risikokomponente	Korrelationsszenario	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in Währung der Rechnungslegung)	Währung der Rechnungslegung	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

**C 120.03 — SBM. OFR**

Portfolionummer	SBM OFR (Ergebnisse in der Währung des EBA-Portfolios)
0010	0020“