

29. Meldung über Marktrisikopositionen Verwendung eigener Risikomodelle

E IM

Institutsnummer:  Prüfziffer:  Name:  Ort:  Stand Ende:

		Potenzieller Risikobetrag		Potenzieller Krisen-Risikobetrag		Anrechnungsbetrag für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko	
		Gewichtungsfaktor x Durchschnitt der potenziellen Risikobeträge der letzten 60 Geschäftstage	Potenzieller Risikobetrag vom Vortag	Gewichtungsfaktor x Durchschnitt der potenziellen Krisen-Risikobeträge der letzten 60 Geschäftstage	Zuletzt berechneter potenzieller Krisen-Risikobetrag	Zwölfwöchiger Durchschnitt der nach §§ 318a bis 318d SolV ermittelten Beträge für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko	Nach §§ 318a bis 318d SolV zuletzt ermittelter Betrag für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko
		01	02	08	09	10	11
010	<b>Positionen</b>						
	Nachrichtlich: gegliedert nach Marktrisiko-kategorien						
020	1 Zinsnettoposition						
030	1.1 Allgemeines Kursrisiko						
040	1.2 Besonderes Kursrisiko						
050	2 Aktiennettoposition						
060	2.1 Allgemeines Kursrisiko						
070	2.2 Besonderes Kursrisiko						
080	3 Währungs-gesamtposition						
090	4 Rohwarenposition						
100	5 Gesamtbetrag für das allgemeine Kursrisiko						
110	6 Gesamtbetrag für das besondere Kursrisiko						

29. Meldung über Marktrisikopositionen Verwendung eigener Risikomodelle

E IM

Institutsnummer:  Prüfziffer:  Name:  Ort:  Stand Ende:

		Anrechnungsbeträge für das Correlation Trading Portfolio				Nachrichtlich:					
		Mindestanrechnungsbetrag für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 4 SolV)	Zwölfwöchiger Durchschnitt der nach § 318e SolV zuletzt ermittelten Beträge für das Correlation Trading Portfolio	Nach § 318e SolV zuletzt ermittelter Betrag für das Correlation Trading Portfolio	Zusätzliche Eigenkapitalanforderung für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 3)	Eigenmittelanforderung	Anzahl der Ausnahmen in den letzten 250 Geschäftstagen	Gewichtungsfaktor nach § 314 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 Buchstabe b SolV	Gewichtungsfaktor nach § 314 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 Buchstabe b SolV	Summe der Berücksichtigungsbeträge für aktivisch ausgerichtete Zinsnettopositionen des Correlation Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 1 SolV)	Summe der Berücksichtigungsbeträge für passivisch ausgerichtete Zinsnettopositionen des Correlation Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 2 SolV)
		12 = 8% * Max [18, 19]	13	14	15	05=Max [01,02] + Max [08,09] + Max [10,11] + Max [12,13,14] + 15	06	16	17	18	19
010	<b>Positionen</b>					<b>Übertrag ÜB-Meldebogen</b>					
	Nachrichtlich: gegliedert nach Marktrisikokategorien										
020	1 Zinsnettoposition										
030	1.1 Allgemeines Kursrisiko										
040	1.2 Besonderes Kursrisiko										
050	2 Aktiennettoposition										
060	2.1 Allgemeines Kursrisiko										
070	2.2 Besonderes Kursrisiko										
080	3 Währungsgesamtposition										
090	4 Rohwarenpotion										
100	5 Gesamtbetrag für das allgemeine Kursrisiko										
110	6 Gesamtbetrag für das besondere Kursrisiko										