

62. Meldung über Marktrisikopositionen Verwendung eigener Risikomodelle (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

Q IM

Instituts-
nummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes
Unternehmen:

Stand Ende:

in Mio Euro

	Potenzieller Risikobetrag		Potenzieller Krisen-Risikobetrag		Zuschlagsbetrag 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 SolvV ermittelten Beträge für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko	Nach §§ 318a bis 318d SolvV zuletzt ermittelter Betrag für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko
	01	02	08	09	10	11
010 Positionen						
Nachrichtlich: gegliedert nach Marktrisiko-kategorien						
020 1 Zinsnettoposition						
030 1.1 Allgemeines Kursrisiko						
040 1.2 Besonderes Kursrisiko						
050 2 Aktiennetto-position						
060 2.1 Allgemeines Kursrisiko						
070 2.2 Besonderes Kursrisiko						
080 3 Währungsgesamt-position						
090 4 Rohwarenposition						
100 5 Gesamtbetrag für das allgemeine Kursrisiko						
110 6 Gesamtbetrag für das besondere Kursrisiko						

62. Meldung über Marktrisikopositionen Verwendung eigener Risikomodelle (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

Q IM

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Stand Ende:

in Mio Euro

		Anrechnungsbeträge für das Correlation Trading Portfolio				Eigenmittel-anforderung	Nachrichtlich:				
		Mindestanrechnungsbetrag für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 4 SolvV)	Zwölfwöchiger Durchschnitt der nach § 318e SolvV zuletzt ermittelten Beträge für das Correlation Trading Portfolio	Nach § 318e SolvV zuletzt ermittelter Betrag für das Correlation Trading Portfolio	Zusätzliche Eigenkapitalanforderung für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 3)		Anzahl der Ausnahmen in den letzten 250 Geschäftstagen	Gewichtungsfaktor nach § 314 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 Buchstabe b SolvV	Gewichtungsfaktor nach § 314 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 Buchstabe b SolvV	Summe der Berücksichtigungsbeträge für aktivisch ausgerichtete Zinsnettopositionen des Correlation Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 1 SolvV)	Summe der Berücksichtigungsbeträge für passivisch ausgerichtete Zinsnettopositionen des Correlation Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 2 SolvV)
		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	Positionen					Übertrag ÜB-Meldebogen					
Nachrichtlich: gegliedert nach Marktrisikokategorien											
020	1 Zinsnettoposition										
030	1.1 Allgemeines Kursrisiko										
040	1.2 Besonderes Kursrisiko										
050	2 Aktiennetto-position										
060	2.1 Allgemeines Kursrisiko										
070	2.2 Besonderes Kursrisiko										
080	3 Währungsgesamt-position										
090	4 Rohwarenposition										
100	5 Gesamtbetrag für das allgemeine Kursrisiko										
110	6 Gesamtbetrag für das besondere Kursrisiko										