

71. Marktrisikomeldungen Correlation Trading Portfolio

MKR QCTP

Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>	Name:	<input type="text"/>
Ort:	<input type="text"/>			Stand:	<input type="text"/>
				Ende:	<input type="text"/>

in Tsd Euro

	Correlation Trading Portfolio-Positionen		(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 303 Abs. 2 Nr. 3 SolvV)		Zinsnettopositionen		Aufgliederung der Nettopositionen mit aktiver Ausrichtung nach Risikogewichten																
							Risikogewichte < 1250%						1250%		Bankaufsichtlicher Formelansatz		Einstufungsverfahren		Andere Risikogewichte				
	Positionen mit aktivischer Ausrichtung	Positionen mit passivischer Ausrichtung	Positionen mit aktivischer Ausrichtung	Positionen mit passivischer Ausrichtung	Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung	7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	250%	350%	425%	650%	Mit Rating	Ohne Rating	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschau	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)			
																						01	02
010	Gesamtsumme																						
020	Originator: Gesamtengagement																						
030	Verbriefungspositionen																						
040	Sonstige Correalion Trading Portfolio-Positionen																						
050	Investor: Gesamtengagement																						
060	Verbriefungspositionen																						
070	Sonstige Correalion Trading Portfolio-Positionen																						
080	Sponsor: Gesamtengagement																						
090	Verbriefungspositionen																						
100	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																						
Nth-to-default-Kreditderivate																							
110	Nth-to-default-Kreditderivate																						
120	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																						

71. Marktrisikomeldungen Correlation Portfolio

MKR QCTP

Institutsnummer: Prüffziffer:

Ort:

Name:

Stand Ende:

in Tsd Euro

	Aufgliederung der Nettositionen mit passivischer Ausrichtung nach Risikogewichten														Risikogewichtete Zinsnettopositionen vor Anwendung der Kappungsregel in § 303 Abs. 1 Satz 3 SolvV		Risikogewichtete Zinsnettopositionen nach Anwendung der Kappungsregel in § 303 Abs. 1 Satz 3 SolvV		Aggregierte Kapitalanforderungen						
	Risikogewichte < 1250%										1250%		Bankaufsichtlicher Formelansatz		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschau	Internes Einstufungsverfahren	Andere Risikogewichte		risikogewichtete Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung		
	7 - 10%		12 - 18%		20 - 35%		40 - 75%		100%		350%		250%											350%	
	24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	34	35	36	37	38	39	40	41		42	43	44	45		
010	Gesamtsumme																			Übertrag ÜB-Meldebogen					
020	Originator: Gesamtengagement																								
030	Verbriefungspositionen																								
040	Sonstige Correalition Trading Portfolio-Positionen																								
050	Investor: Gesamtengagement																								
060	Verbriefungspositionen																								
070	Sonstige Correalition Trading Portfolio-Positionen																								
080	Sponsor: Gesamtengagement																								
090	Verbriefungspositionen																								
100	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																								
	Nth-to-default-Kreditderivate																								
110	Nth-to-default-Kreditderivate																								
120	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																								