

32. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition

MKR ZK

Institutsnummer: _____ Prüfziffer: _____ Name: _____ Stand Ende: _____ Blatt 2
 Ort: _____

Allgemeines Kursrisiko Zinsnettoposition

- in Tsd Euro -

Nominalverzinsung < 3 % bzw. gemäß Duration			Langfristige Laufzeitzone							
			über 3,6 bis zu 4,3 Jahren	über 4,3 bis zu 5,7 Jahren	über 5,7 bis zu 7,3 Jahren	über 7,3 bis zu 9,3 Jahren	über 9,3 bis zu 10,6 Jahren	über 10,6 bis zu 12,0 Jahren	über 12,0 bis zu 20,0 Jahren	über 20,0 Jahren
Nominalverzinsung ≥ 3 %			über 4 bis zu 5 Jahren	über 5 bis zu 7 Jahren	über 7 bis zu 10 Jahren	über 10 bis zu 15 Jahren	über 15 bis zu 20 Jahren	über 20 Jahren		
			09	10	11	12	13	14	15	16
I. Jahresbandmethode Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	110								
	Insgesamt	passivische Ausrichtung	120							
darunter: in Euro	aktivische Ausrichtung	130								
	passivische Ausrichtung	140								
darunter: in US-\$	aktivische Ausrichtung	150								
	passivische Ausrichtung	160								
II. Durationsmethode: Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	170								
	Insgesamt	passivische Ausrichtung	180							
gewichtete Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	190								
	Insgesamt	passivische Ausrichtung	200							
darunter: gewichtete Zinsnettoposition in Euro	aktivische Ausrichtung	210								
	passivische Ausrichtung	220								
darunter: gewichtete Zinsnettoposition in US-\$	aktivische Ausrichtung	230								
	passivische Ausrichtung	240								

32. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition

MKR ZK

Institutsnummer: _____ Prüfziffer: _____ Name: _____ Stand Ende: _____ Blatt 3
 Ort: _____

Besonderes Kursrisiko Zinsnettoposition

- in Tsd Euro -

Positionen		Zinsnettoposition	Gewichtungssätze	risikogewichtete Zinsnettoposition	Gewichtung nach § 303 Abs. 1	Anrechnungsbeträge
		01	02	03	04	05
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 2	310		x 0,0 %		X 8 %	
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 3 Restlaufzeit bis 6 Monate	320		x 3,125 %			
Restlaufzeit über 6 Monate bis zu 2 Jahren	330		x 12,5 %			
Restlaufzeit von mehr als 2 Jahren	340		x 20,0 %			
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 1	350		x 100,0 %			
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 4	360		x 150,0 %			
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 5	370					
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 6	380					
Summe Zinsnettopositionen	400			Teilanrechnungsbetrag für das besondere Kursrisiko		

Pauschalierter Anrechnungsbetrag für Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 1 und 2 SolvV

Positionen		Maßgeblicher Betrag	Gewichtungssätze	Anrechnungsbeträge
		01	02	03
Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 1	500		X 32%	
Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 2	510		X 40 %	
Summe	520			