

Funds sheet

Erhebung **Basel3**
Formular **[P/C]_CRFUNDS_Erl**

ID	Bezeichnung	Referenz zu Regulierungstexten und Bemerkungen
Zeilen		
	Look-Through Ansatz (LTA)	FINMA-RS 2017/7 "Kreditrisiken – Banken" Rz 338–344
001	alle VKV-Anteile unter dem LTA	Alle VKV-Anteile, die gemäss der in Rz 337 beschriebenen Hierarchie nach dem LTA behandelt werden
002	davon: alle VKV-Anteile unter dem LTA, die von der Bank selbst gemanaged werden	Von den in Zeile 001 angegebenen Investments: diejenigen, die von der Bank selbst gemanaged werden
	Mandatsbasierter Ansatz (MBA)	FINMA-RS 2017/7 "Kreditrisiken – Banken" Rz 345–350
003	alle VKV-Anteile unter dem MBA	Alle VKV-Anteile, die gemäss der in Rz 337 beschriebenen Hierarchie nach dem MBA behandelt werden
004	davon: alle VKV-Anteile unter dem MBA, die von der Bank selbst gemanaged werden	Von den in Zeile 003 angegebenen Investments: diejenigen, die von der Bank selbst gemanaged werden
	Fallback-Ansatz (FBA)	FINMA-RS 2017/7 "Kreditrisiken – Banken" Rz 351
005	alle VKV-Anteile unter dem FBA	Alle VKV-Anteile, die gemäss der in Rz 337 beschriebenen Hierarchie nach dem FBA behandelt werden
006	davon: alle VKV-Anteile unter dem FBA, die von der Bank selbst gemanaged werden	Von den in Zeile 005 angegebenen Investments: diejenigen, die von der Bank selbst gemanaged werden
	Vereinfachter Ansatz	FINMA-RS 2017/7 "Kreditrisiken – Banken" Rz 335 und 352
007	alle VKV-Anteile unter dem vereinfachten Ansatz mit 250%	Alle VKV-Anteile, die gemäss der in Rz 337 beschriebenen Hierarchie nach dem vereinfachten Ansatz behandelt und mit 250% risikogewichtet werden
008	davon: alle VKV-Anteile unter dem vereinfachten Ansatz, die von der Bank selbst gemanaged werden	Von den in Zeile 007 angegebenen Investments: diejenigen, die von der Bank selbst gemanaged werden
024	alle VKV-Anteile unter dem vereinfachten Ansatz mit 400%	Alle VKV-Anteile, die gemäss der in Rz 337 beschriebenen Hierarchie nach dem vereinfachten Ansatz behandelt und mit 400% risikogewichtet werden
025	davon: alle VKV-Anteile unter dem vereinfachten Ansatz, die von der Bank selbst gemanaged werden	Von den in Zeile 024 angegebenen Investments: diejenigen, die von der Bank selbst gemanaged werden
009 – 013	LTA Exposure nach Risikogewicht	Für die in Zeile 001 angegebenen Investments: Aufgliederung nach Risikogewicht unter dem LTA
014 – 018	MBA Exposure nach Risikogewicht	Für die in Zeile 003 angegebenen Investments: Aufgliederung nach Risikogewicht unter dem MBA
019	Vereinfachter Ansatz 250% Risikogewicht	Gleiche Investments wie in Zeile 007 angegeben
020	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert 1	Von den in Zeile 019 angegebenen Investitionen: jene mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 1 gemäss der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen, Anhang 3, Abschnitt 3 "Risiko- und Ertragsprofil"
021	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert 2	Von den in Zeile 019 angegebenen Investitionen: jene mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 2 gemäss der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen, Anhang 3, Abschnitt 3 "Risiko- und Ertragsprofil"
022	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert 3	Von den in Zeile 019 angegebenen Investitionen: jene mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 3 gemäss der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen, Anhang 3, Abschnitt 3 "Risiko- und Ertragsprofil"
023	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert 4	Von den in Zeile 019 angegebenen Investitionen: jene mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 4 gemäss der Verordnung über

Funds sheet

Erhebung **Basel3**
Formular **[P/C]_CRFUNDS_Erl**

ID	Bezeichnung	Referenz zu Regulierungstexten und Bemerkungen
		die kollektiven Kapitalanlagen, Anhang 3, Abschnitt 3 "Risiko- und Ertragsprofil"
026	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert 5	Von den in Zeile 019 angegebenen Investitionen: jene mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 5 gemäss der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen, Anhang 3, Abschnitt 3 "Risiko- und Ertragsprofil"
027	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert 6	Von den in Zeile 019 angegebenen Investitionen: jene mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 6 gemäss der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen, Anhang 3, Abschnitt 3 "Risiko- und Ertragsprofil"
028	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert 7	Von den in Zeile 019 angegebenen Investitionen: jene mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 7 gemäss der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen, Anhang 3, Abschnitt 3 "Risiko- und Ertragsprofil"
029	Vereinfachter Ansatz 400% Risikogewicht	Gleiche Investments wie in Zeile 024 angegeben
030	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert 5	Von den in Zeile 029 angegebenen Investitionen: jene mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 5 gemäss der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen, Anhang 3, Abschnitt 3 "Risiko- und Ertragsprofil"
031	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert 6	Von den in Zeile 029 angegebenen Investitionen: jene mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 6 gemäss der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen, Anhang 3, Abschnitt 3 "Risiko- und Ertragsprofil"
032	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert 7	Von den in Zeile 029 angegebenen Investitionen: jene mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 7 gemäss der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen, Anhang 3, Abschnitt 3 "Risiko- und Ertragsprofil"
Spalten		
01	Anzahl der Investments	Anzahl der verwalteten kollektiven Vermögen, in die die Bank investiert ist. Wird ein verwaltetes kollektives Vermögen nach mehreren Ansätzen behandelt, so ist das Investment unter jedem dieser Ansätze zu zählen.
02	Kreditäquivalent für das Gegenparteikreditrisiko von SFTs	Kreditäquivalent für das Gegenparteikreditrisiko von SFTs (FINMA-RS 2017/7 "Kreditrisiken – Banken" Rz 131, 163–278)
03	Kreditäquivalent für das Gegenparteikreditrisiko von Derivaten	Kreditäquivalent für das Gegenparteikreditrisiko von Derivaten (FINMA-RS 2017/7 "Kreditrisiken – Banken" Rz 32–123)
04	Risikogewichtete Position für das Gegenparteikreditrisiko von SFTs und Derivaten (inkl. CVA)	Kreditäquivalente der Spalten 02 und 03 multipliziert mit den entsprechenden Risikogewichten zzgl. der (in RWA umgerechneten) CVA-Anforderung
05	Totale Netto-Position vor Risikogewichtung	Totale Netto-Position in VKV-Anteilen, inklusive der Kreditäquivalente für das in Zeile 04 angegebene Gegenparteikreditrisiko
06	Risikogewichtete Position	Risikogewichtete Position: Summe der einzelnen risikogewichteten Netto-Positionen (Spalte 05)
07	Mindesteigenmittel (ohne Multiplikatoren)	Mindesteigenmittel in Höhe von 8% der risikogewichteten Position (Spalte 06) ohne Anwendung von Multiplikatoren