

Credit Valuation Adjustments (CVA) und Gegenparteirisiko Memorandum Items

ID	Bezeichnung	Referenz zu Regulierungstexten und Bemerkungen
Spalten		
1	Derivate	Positionen gemäss Art. 56 – Art. 59 ERV
2	Darlehens-, Repo- und repoähnliche Geschäfte mit Effekten (SFT)	Positionen gemäss Art. 75 ERV
Zeilen		
1	Kreditäquivalente („Exposure at Default“, EAD)	Betrag der Kreditäquivalente, wobei Sicherheiten und Verrechnungen berücksichtigt werden (Art. 56-59 Eigenmittelverordnung, Art. 75 Eigenmittelverordnung und Art. 62 Eigenmittelverordnung), jedoch ohne Berücksichtigung von Credit Valuation Adjustments (CVA) (FINMA-RS. 17/7, Rz 474) Für Derivate: Summe von 1.2, 1.3 und 1.4 Für SFTs: Summe von 1.1, 1.2, 1.3 und 1.4
1.1	davon: bilaterale SFT-Engagements, die nicht der CVA-Eigenmittelanforderung unterliegen	EAD von SFTs, die nicht der CVA-Eigenmittelanforderung unterliegen (FINMA-RS 17/7, Rz 491)
1.2	davon: Engagements, die der vereinfachten CVA-Eigenmittelanforderung unterliegen	EAD, der in die vereinfachte CVA-Eigenmittelanforderung einfliesst (FINMA-RS 17/7, Rz 514-518)
1.3	davon: Engagements, die der standardisierten CVA-Eigenmittelanforderung unterliegen	EAD, der in die standardisierte CVA-Eigenmittelanforderung einfliesst (FINMA-RS 17/7, Rz 494-513)
1.4	davon: Engagements, die der fortgeschrittenen CVA-Eigenmittelanforderung unterliegen	EAD von Engagements, die in die fortgeschrittene CVA-Eigenmittelanforderung einfließen (FINMA-RS 17/7, Rz 493)
2	CVA	Credit Valuation Adjustments (CVA), die FINMA-RS 17/7 Rz 474 unterliegen
3	Ausstehende EAD (um CVA reduziert)	Die ausstehende EAD pro Netting Set berechnet sich als $\text{Max}[\text{EAD} - \text{CVA}, 0]$ (FINMA-RS 17/7 Rz 474)
4	Risikogewichtete Summe der EAD	Summe der risikogewichteten, ausstehenden EADs

Weitere Informationen siehe Website www.snb.ch, *Statistiken, Erhebungen*:

- Aktuelle Informationen
- Elektronische Formulare zum Herunterladen
- Wichtige Informationen zum Meldewesen
- Kontakte