

Kreditrisiko: Beteiligungstitel – Erforderliche Eigenmittel gemäss auf internen Ratings basierendem Ansatz (IRB)

ID	Bezeichnung	Referenz zu Regulierungstexten und Bemerkungen
Kolonnen		
01	Internes Ratingsystem	Vgl. Formular CRIRB.
01	Der Ratingklasse zugeordnete PD	Anwendbar auf Beteiligungstitel, welche gemäss dem PD/LGD-Ansatz behandelt werden. Vgl. Kommentar zur Kolonne «Der Ratingklasse oder dem Pool zugeordnete PD» des Formulars CRIRB, sowie §350–355 der Basler Mindeststandards.
02	Positionswert vor Anwendung der Kreditumrechnungsfaktoren	§359–361 der Basler Mindeststandards.
03	Positionswert nach Anwendung der Kreditumrechnungsfaktoren	Rz 340 des Rundschreibens Kreditrisiken Banken und Art. 54 ERV.
04–07	Risikomindernde Massnahmen mit Substitutionseffekt	Vgl. Formular CRIRB und §345, 349 und 355 der Basler Mindeststandards.
04	Garantien	Vgl. Formular CRIRB.
05	Kreditderivate	Vgl. Formular CRIRB.
06–07	Substitutionseffekte	Vgl. Formular CRIRB.
06	Abflüsse (–)	Vgl. Formular CRIRB.
07	Zuflüsse (+)	Vgl. Formular CRIRB.
08	Positionswert nach risikomindernden Massnahmen mit Substitutionseffekt und nach Kreditumrechnungsfaktoren	Vgl. Formular CRIRB.
09	Positionswert-gewichtete mittlere LGD (%)	Anwendbar auf Beteiligungstitel, welche gemäss dem PD/LGD-Ansatz behandelt werden. Vgl. auch §350–355 der Basler Mindeststandards.
10	Risikogewichtete Position	Für die einfache Risikogewichtungsmethode, §344–345 der Basler Mindeststandards. Für die interne Modellmethode, §346–349 der Basler Mindeststandards und Präzisierungen in den Rz 359 und 361 des Rundschreibens Kreditrisiken Banken. Für den PD/LGD-Ansatz, §350–355 der Basler Mindeststandards.
11	Erforderliche Eigenmittel	Vgl. Formular CRIRB.
12	Erwarteter Verlust	§375, 376 der Basler Mindeststandards.
13	Wertberichtigungen und spezifische	Vgl. Formular CRIRB.

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

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

Kreditrisiko: Beteiligungstitel – Erforderliche Eigenmittel gemäss auf internen Ratings basierendem Ansatz (IRB)

Rückstellungen

Zeilen		
01–105	Positionswerte der IRB Beteiligungstitel	§235–238 der Basler Mindeststandards und Präzisierungen in den Rz 320–322 und 354 des Rundschreibens Kreditrisiken Banken.
02, 104, 105	Einfache Risikogewichtungsmethode	§344–345 der Basler Mindeststandards.
06	Interne Modellmethode	§346–349 der Basler Mindeststandards und Präzisierungen in den Rz 359–361 des Rundschreibens Kreditrisiken Banken.
07–N	PD/LGD-Ansatz	§350–355 der Basler Mindeststandards.
08–N	Ratingklasse	Vgl. Kommentar zur Zeile «Ratingklasse oder Pool» des Formulars CRIRB.
100	Ausgefallene Positionen	Rz 370 des Rundschreibens Kreditrisiken Banken.

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

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