

Mindesteigenmittel für Marktrisiken MKR_BIZ

Standardansatz gemäss Art. 84-87 ERV

Kolonne 01	Position
Kolonne 02	Anforderungsfaktor
Kolonne 03	Anforderung
Marktrisiko von Devisen, Gold und Rohstoffen	
Zeile 001	Devisen (1)
Zeile 002	Gold (Nettoposition)
Zeile 089	Rohstoffe gemäss Laufzeitbandverfahren
Zeile 090	Rohstoffe gemäss vereinfachtem Verfahren
Zeile 005	Total
De-Minimis-Test	
Die nachfolgenden 4 Abschnitte zu spezifischem und allgemeinem Marktrisiko müssen nur ausgefüllt werden, falls das Handelsbuch während der relevanten Periode mindestens einmal entweder CHF 30 Mio. oder 6% der Summe aller bilanziellen und ausserbilanziellen Positionen gemäss Pos. 08 überschritten hat.	
Zeile 006	Bilanzsumme des letzten Quartals
Zeile 007	Eventualverbindlichkeiten, Unwiderrufliche Zusagen, Einzahlungs- und Nachschussverpflichtungen, Verpflichtungskredite, Kontraktvolumen der derivativen Finanzinstrumente
Zeile 008	Total Bilanz und Ausserbilanz
Zeile 009	Handelsbuch (Art. 5 ERV) (2)
Zeile 010	Handelsbuch in % des Totals von Bilanz und Ausserbilanz

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

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

Mindesteigenmittel für Marktrisiken MKR_BIZ

Spezifisches Risiko von Zinsinstrumenten	
Nicht verbriefte Positionen	
Zinsinstrumente von Zentralregierungen und Zentralbanken	
Zeile 011	Ratingklasse 1 oder 2
Zeile 012	Ratingklasse 3 oder 4 Restlaufzeit \leq 6 Monate
Zeile 013	Ratingklasse 3 oder 4 Restlaufzeit > 6 Monate und \leq 24 Monate
Zeile 014	Ratingklasse 3 oder 4 Restlaufzeit > 24 Monate
Zeile 015	Ratingklasse 5 oder 6
Zeile 016	Ratingklasse 7
Zeile 017	Ohne Rating
Qualifizierte Zinsinstrumente nach Art. 4 Bst. e ERV	
Zeile 018	Restlaufzeit \leq 6 Monate
Zeile 019	Restlaufzeit > 6 Monate und \leq 24 Monate
Zeile 020	Restlaufzeit > 24 Monate
Übrige Zinsinstrumente	
Zeile 021	Ratingklasse 5
Zeile 022	Ratingklasse 6 oder 7
Zeile 023	Ohne Rating
Zeile 024	Total

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

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

Mindesteigenmittel für Marktrisiken MKR_BIZ

Verbriefte Positionen	
Zeile 080	ohne Korrelationshandel
Zeile 091	für Netto Long Positionen
Zeile 092	für Netto Short Positionen
Zeile 081	Korrelationshandel
Zeile 093	für Netto Long Positionen
Zeile 094	für Netto Short Positionen
Zeile 082	Total
Allgemeines Marktrisiko von Zinsinstrumenten	
Zeile 025	Wert gemäss Laufzeitmethode
Zeile 026	Wert gemäss Durationsmethode
Zeile 027	Total
Spezifisches Risiko von Beteiligungstiteln	
Zeile 030	Summe der Nettopositionen pro Emittent
Zeile 031	Total
Allgemeines Marktrisiko von Beteiligungstiteln	
Zeile 032	Summe der Nettopositionen pro nationalem Markt
Zeile 033	Total
Anforderungen für Optionen nach dem vereinfachten Verfahren	
Zeile 034	Optionen auf Zinsinstrumente
Zeile 035	Optionen auf Aktien oder Aktienindizes

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

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

Mindesteigenmittel für Marktrisiken MKR_BIZ

Zeile 036	Optionen auf Devisen
Zeile 037	Optionen auf Gold
Zeile 038	Optionen auf Rohstoffe
Zeile 039	Total
Zusätzliche Anforderungen für Optionen nach dem Delta-Plus-Verfahren (3)	
Gamma Risiko	
Zeile 040	Optionen auf Zinsinstrumente
Zeile 041	Optionen auf Aktien oder Aktienindizes
Zeile 042	Optionen auf Devisen
Zeile 043	Optionen auf Gold
Zeile 044	Optionen auf Rohstoffe
Zeile 045	Total
Vega-Risiko	
Zeile 046	Optionen auf Zinsinstrumente
Zeile 047	Optionen auf Aktien oder Aktienindizes
Zeile 048	Optionen auf Devisen
Zeile 049	Optionen auf Gold
Zeile 050	Optionen auf Rohstoffe
Zeile 051	Total

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

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

Mindesteigenmittel für Marktrisiken MKR_BIZ

Anforderungen für Optionen nach der Szenario-Analyse	
Zeile 052	Optionen auf Zinsinstrumente
Zeile 053	Optionen auf Aktien oder Aktienindizes
Zeile 054	Optionen auf Devisen
Zeile 055	Optionen auf Gold
Zeile 056	Optionen auf Rohstoffe
Zeile 057	Total
Anforderungen für Marktrisiken nach dem Modellverfahren gemäss Art. 88 ERV	
Durchschnittlicher VaR	
Zeile 058	Zinsrisiken
Zeile 059	Aktienkursrisiken (4)
Zeile 060	Devisenrisiken
Zeile 061	Edelmetall- und Rohstoffrisiken
Zeile 062	Total Value-at-Risk
Zeile 063	Anforderung unter Berücksichtigung des institutsspezifischen Multiplikationsfaktors
Zeile 066	Total
VaR vom Vortag	
Zeile 067	Zinsrisiken
Zeile 068	Aktienkursrisiken (4)
Zeile 069	Devisenrisiken

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

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

Mindesteigenmittel für Marktrisiken MKR_BIZ

070 Zeile	Edelmetall- und Rohstoffrisiken
Zeile 071	Total Value-at-Risk
Zeile 074	Total
Stress-basierter VaR	
Zeile 083	Gesamter durchschn. stress-basierter VaR unter Berücksicht. des institutspez. Multiplikationsfaktors
Zeile 084	Gesamter letzter verfügbarer stress-basierter VaR
IRC	
Zeile 085	Durchschnittliche IRC
Zeile 086	Letzte verfügbare IRC
CRM	
Zeile 087	Durchschnittliche CRM
Zeile 088	Letzte verfügbare CRM
Zeile 095	8% der Anforderung für spezifische Risiken nach Standardansatz
Zeile 096	8% der Netto Long Positionen
Zeile 097	8% der Netto Short Positionen
Total der Anforderungen nach dem Modellverfahren	
Zeile 075	(Die Summe der grösseren Beträge der Zeilen 66 und 74, 83 und 84, 85 und 86, 87 und 88 und 95)

- (1) Massgebend ist der höhere Betrag der Summe der Netto-Longpositionen einerseits und der Summe der Netto-Shortpositionen andererseits.
- (2) Summe der absoluten Marktwerte sämtlicher Long- und Shortpositionen (pro Emittent) in den Basisinstrumenten zuzüglich der (deltagewichteten) Kontraktvolumen sämtlicher derivativen Finanzinstrumente im Handelsbuch.

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

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

Mindesteigenmittel für Marktrisiken MKR_BIZ

- (3) Die Delta-Äquivalente sind in den vorangehenden Abschnitten zum Marktrisiko von Devisen, Gold und Rohstoffen, zu spezifischen Risiken und allgemeinen Marktrisiken (Zeilen 01–33) enthalten. De-Minimis-Institute müssen für Optionen auf Zinsinstrumente und für Optionen auf Aktien oder Aktienindizes weder für das Gamma noch für das Vega-Risiko Eigenmittelanforderungen bestimmen (betrifft die Zeilen 40, 41, 46, 47).

Einschliesslich Ereignisrisiken gemäss Rz 282 des Rundschreibens Marktrisiken Banken.