Amtsblatt
der Europäischen Union

DE
Reihe L

2025/379

12.3.2025

DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2025/379 DER KOMMISSION

vom 26. Februar 2025

zur Änderung der in der Durchführungsverordnung (EU) 2016/2070 der Kommission festgelegten technischen Durchführungsstandards im Hinblick auf Referenzportfolios, Meldebögen und Erläuterungen, die in der Union für Meldungen gemäß Artikel 78 Absatz 2 der Richtlinie 2013/36/EU des Europäischen Parlaments und des Rates zu verwenden sind

(Text von Bedeutung für den EWR)

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Richtlinie 2013/36/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über den Zugang zur Tätigkeit von Kreditinstituten und die Beaufsichtigung von Kreditinstituten und Wertpapierfirmen, zur Änderung der Richtlinie 2002/87/EG und zur Aufhebung der Richtlinien 2006/48/EG und 2006/49/EG ([1]), insbesondere auf Artikel 78 Absatz 8 Unterabsatz 3,

in Erwägung nachstehender Gründe:

(1) Nach Artikel 78 Absatz 1 der Richtlinie 2013/36/EU müssen Institute, die interne Ansätze anwenden dürfen, die Ergebnisse, die sie nach ihren internen Ansätzen zur Berechnung von risikogewichteten Positionsbeträgen oder Eigenmittelanforderungen für ihre in den Referenzportfolios enthaltenen Risikopositionen oder Positionen erzielen, in angemessenen zeitlichen Abständen, jedoch mindestens jährlich an ihre zuständige Behörde melden, damit diese die Qualität dieser internen Ansätze bewerten kann („Benchmarking“). Nach Artikel 78 Absatz 3 Unterabsatz 2 dieser Richtlinie hat die Europäische Bankenaufsichtsbehörde (im Folgenden „EBA“) einen Bericht zu erstellen, um die zuständigen Behörden bei der Bewertung der Qualität der internen Ansätze der Institute auf der Grundlage der Ergebnisse des Benchmarkings zu unterstützen. Die Kommission hat die Meldepflichten für das Benchmarking in ihrer Durchführungsverordnung (EU) 2016/2070 ([2]) spezifiziert, die mehrfach geändert wurde. Um den sich wandelnden Schwerpunkten der von den zuständigen Behörden und in den EBA-Berichten angestellten Bewertungen sowie den Änderungen der Rechtsvorschriften im Bereich des Marktrisikos Rechnung zu tragen, müssen die Referenzportfolios ebenso wie die in der genannten Durchführungsverordnung festgelegten Meldepflichten erneut aktualisiert werden.

(2) Mit Blick auf das Kreditrisiko-Benchmarking sollten die Erläuterungen so geändert werden, dass deutlich wird, dass die Risikoparameter Ausfallwahrscheinlichkeit (PD) und Verlustquote bei Ausfall (LGD) in Bezug auf die Sicherheitsspanne (MoC), den aufsichtlichen Zuschlagsfaktor und die Abschwungkomponente (DWT) gemeldet werden müssen, die bei den Modellen zu Schwankungen führen können. Darüber hinaus sollte präzisiert werden, dass die Institute die von der zuständigen Behörde zugewiesene Modell-ID melden müssen, damit die gemeldeten Daten leichter zuzuordnen sind.

(3) Mit der Delegierten Verordnung (EU) 2024/2795 der Kommission ([3]) wurde der Geltungsbeginn der neuen Eigenmittelanforderungen für das Marktrisiko verschoben. Deshalb werden die Meldebögen für den bestehenden auf internen Modellen basierenden Ansatz bei diesem Benchmarkingzyklus nicht ersetzt. Zugleich sollten die Meldebögen für die Validierung des Standardansatzes gegenüber 2024, als nur Zinsinstrumente erfasst wurden, um zusätzliche Portfolios erweitert werden. Damit soll eine angemessene Aufsicht und eine reibungslose Umsetzung des neuen Standardansatzes sichergestellt werden, der für die Berechnung der Eigenmitteluntergrenze (Output-Floor) verwendet wird.

([1]) ABl. L 176 vom 27.6.2013, S. 338, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj.

([2]) Durchführungsverordnung (EU) 2016/2070 der Kommission vom 14. September 2016 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für Meldebögen, Begriffsbestimmungen und IT-Lösungen, die von Instituten für Meldungen an die Europäische Bankenaufsichtsbehörde und an zuständige Behörden gemäß Artikel 78 Absatz 2 der Richtlinie 2013/36/EU des Europäischen Parlaments und des Rates zu verwenden sind (ABl. L 328 vom 2.12.2016, S. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) Delegierte Verordnung (EU) 2024/2795 der Kommission vom 24. Juli 2024 zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf den Geltungsbeginn der Eigenmittelanforderungen für das Marktrisiko (ABl. L, 2024/2795, 31.10.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) Die Durchführungsverordnung (EU) 2016/2070 sollte daher entsprechend geändert werden.

(5) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Durchführungsstandards, der der Kommission von der EBA vorgelegt wurde.

(6) Die EBA hat zu diesem Entwurf öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates [4] eingesetzten Interessengruppe Bankensektor eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Die Durchführungsverordnung (EU) 2016/2070 wird wie folgt geändert:

1. Anhang IV wird durch Anhang I der vorliegenden Verordnung ersetzt.
2. Anhang V wird durch Anhang II der vorliegenden Verordnung ersetzt.
3. Anhang VI wird durch Anhang III der vorliegenden Verordnung ersetzt.
4. Anhang VII wird durch Anhang IV der vorliegenden Verordnung ersetzt.
5. Anhang X wird durch Anhang V der vorliegenden Verordnung ersetzt.

Artikel 2

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 26. Februar 2025

Für die Kommission
Die Präsidentin
Ursula VON DER LEYEN

[4] Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Bankenaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/78/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 12, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

ANHANG I

„ANHANG IV

ERGEBNISSE DER AUFSICHTLICHEN REFERENZPORTFOLIOS

TEIL I: ALLGEMEINE ERLÄUTERUNGEN

TEIL II: MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN

C 101 – Nähere Angaben zu Risikopositionen in Portfolios mit niedrigem Ausfallrisiko nach Gegenpartei

C 102 – Nähere Angaben zu Risikopositionen in Portfolios mit niedrigem Ausfallrisiko

C 103 – Nähere Angaben zu Risikopositionen in Portfolios mit hohem Ausfallrisiko

C 105.01 – Bestimmung interner Modelle

C 105.02 – Zuordnung interner Modelle zu Portfolios

C 105.03 – Zuordnung interner Modelle zu Ländern

TEIL I: ALLGEMEINE ERLÄUTERUNGEN

1. Angaben sind nur für diejenigen Gegenparteien und Portfolios zu übermitteln, für die zum Stichtag tatsächlich eine Risikoposition entweder in Form einer Ursprungsrisikoposition oder in Form einer Risikoposition nach Kreditrisikominderung (CRM) vorhanden ist. Gegenparteien und Portfolios, für die zum Stichtag keine Risikoposition besteht, sind nicht anzugeben.

2. Angaben sind nur für diejenigen Risikopositionen zu übermitteln, für die die zuständige Behörde ein internes Modell für die Berechnung der risikogewichteten Risikopositionsbeträge (RWEAs) nach dem Standardansatz genehmigt hat. In den Meldebogen C 101 dürfen keine Gegenpartei-Codes mit der Endung ‚STDA' aufgenommen werden. Bei den übrigen Gegenpartei-Codes im Meldebogen C 101 von Anhang I und den in den Meldebögen C 102 und C 103 genannten Referenzportfolios sind Risikopositionen nach dem Standardansatz und Risikopositionen, für die die jeweils zuständige Behörde eine vorübergehende oder dauerhafte Teilanwendung des Standardansatzes genehmigt hat, auszuschließen.

3. Felder für Informationen, die nicht zutreffend/ unklar definiert sind, sind entweder leer zu lassen oder mit der Angabe ‚NULL' zu versehen; dies gilt auch für EAD-(exposure at default-)gewichtete Mengen oder Parameter, die nicht berechnet werden können. Auch Datenfelder, die nicht gemeldet werden müssen, können leer bleiben oder mit der Angabe ‚NULL' versehen werden. Der Wert ‚0' ist nur dann anzugeben, wenn tatsächlich die Menge oder der Parameter ‚0' gemeldet werden soll. Für Mengen oder Parameter, die gleich 0 sind, darf weder die Angabe ‚blank' noch die Angabe ‚NULL' verwendet werden.

4. Geldbeträge sind auf dieselbe Art und Weise anzugeben wie für die Berechnung der Eigenmittelanforderungen zu einem bestimmten Stichtag gemäß der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451 der Kommission ([1]).

([1]) Durchführungsverordnung (EU) 2021/451 der Kommission vom 17. Dezember 2020 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates auf die aufsichtlichen Meldungen der Institute und zur Aufhebung der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 680/2014 (ABl. L 97 vom 19.3.2021, S. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

TEIL II: MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN

C 101 – Nähere Angaben zu Risikopositionen in Portfolios mit niedrigem Ausfallrisiko nach Gegenpartei

Spezialfinanzierungspositionen sind nicht zu berücksichtigen.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Code der Gegenpartei	Meldebogen C 101 Spalte 0010 in Anhang I	Angabe des Codes der in das Musterportfolio mit geringem Ausfallrisiko (‚LDP') einbezogenen Gegenpartei in Spalte 0010 von Meldebogen C 101 in Anhang I. Dieser Code ist eine Zeilenkennung und kennzeichnet im Meldebogen jeweils eine Zeile.
0020	Risikopositi-ons-klasse	Anhang II Nummer 76 der Durchführungs-ver-ordnung (EU) 2021/451	Jede Gegenpartei ist einer der folgenden Risikopositionsklassen zuzuweisen: a) Zentralbanken und Zentralstaaten; b) Institute; c) Unternehmen – KMU (kleine und mittlere Unternehmen); d) Unternehmen – Spezialfinanzierungen; e) Unternehmen – Sonstige; f) Mengengeschäft – Durch Immobilien besichert, KMU; g) Mengengeschäft – Durch Immobilien besichert, keine KMU; h) Mengengeschäft – Qualifiziert revolvierend; i) Mengengeschäft – Sonstige, KMU; j) Mengengeschäft – Sonstige, keine KMU; k) Nicht zutreffend. ‚Nicht zutreffend' ist anzugeben, wenn keine der aufgelisteten Möglichkeiten zutrifft, was der Fall ist, wenn die Risikopositionen gegenüber einer Gegenpartei verschiedenen Risikopositionsklassen zugeordnet werden, ohne dass eine Klasse eindeutig vorherrscht.
0040	Einstufung		Anzugeben ist der Rang der internen Ratingstufe, die der Gegenpartei innerhalb der geltenden internen Ratingskala des Instituts zugewiesen wurde. Sie folgt der numerischen Reihenfolge 1, 2, 3 usw., vom niedrigsten Risiko zum höchsten Risiko, ausgenommen Ausfälle mit einer PD von 100 %. Verwendet ein Institut eine fortlaufende Risikoeinstufungsskala im Sinne von Artikel 169 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates ([2]), sind die in Spalte 0005 von Meldebogen C 08.02 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451 angegebenen Ratingstufen zu verwenden. Wurden Risikopositionen gegenüber einer Gegenpartei gemäß Artikel 172 Absatz 1 Buchstabe e Ziffern i oder iii der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 mehreren Ratingstufen zugewiesen, ist die Ratingstufe null (0) einzutragen.

([2]) Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 646/2012 (ABl. L 176 vom 27.6.2013, S. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0050	Zeitpunkt der letzten Einstufung der Gegenpartei		Hier ist das Datum der letzten Einstufung der Gegenpartei anzugeben.
0060	PD	Meldebogen C 08.01 Spalte 0010 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist die der Gegenpartei zugewiesene PD. Die PD entspricht der bei der Berechnung der RWEA verwendeten PD, wobei die Auswirkungen von Maßnahmen nach Artikel 458 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unberücksichtigt bleiben. Die PD wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt.
0070	Ausfallstatus		Anzugeben ist der Ausfallstatus der Gegenpartei. Dabei ist nach Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 eine der folgenden Möglichkeiten auszuwählen: a) Ausgefallen; b) Nicht ausgefallen;
0080	Ursprungsrisiko-position vor Anwendung von Umrechnungs-faktoren	Meldebogen C 08.01 Spalte 0020 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der Ursprungsrisikopositionswert vor Berücksichtigung von Wertberichtigungen, Rückstellungen, auf Kreditrisikominderungstechniken zurückzuführenden Effekten oder Kreditumrechnungsfaktoren.
0090	Risikoposition nach Substitutions-effekten aufgrund von Kreditrisiko-minderungen (CRM) vor Anwendung von Umrechnungs-faktoren	Meldebogen C 08.01 Spalte 0090 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Angabe des Betrags, auf den Umrechnungsfaktoren (‚CCFs') angewendet werden, um die gesamte Forderungshöhe bei Ausfall (EAD) (Spalte 0110) zu erhalten. Hierbei sind Techniken der Kreditrisikominderung mit Substitutionseffekten auf die Risikoposition zu berücksichtigen.
0100	CCF	Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben ist der gewichtete Durchschnitt der CCFs. Als Gewichtungsfaktoren werden die Beträge verwendet, auf die zur Ermittlung der EAD die CCFs angewandt werden. Bei Gegenparteien, deren Fazilitäten ausschließlich den in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten entsprechen, muss der gemeldete gewichtete CCF-Durchschnitt auf allen Fazilitäten beruhen. Bei Gegenparteien, deren Fazilitäten nicht unter die in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten fallen, wird der CCF entweder leer gelassen oder mit der Angabe ‚NULL' versehen.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			Bei Gegenparteien mit Fazilitäten, die den in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten entsprechen, und Fazilitäten, die nicht unter die in Artikel 166 Absatz 8 der genannten Verordnung genannten Posten fallen, wird der gemeldete gewichtete CCF-Durchschnitt nur anhand der Fazilitäten ermittelt, die den in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten entsprechen. Bei der Berechnung nicht zu berücksichtigen sind insbesondere die Fazilitäten, die den in Artikel 166 Absatz 10 der genannten Verordnung genannten Posten entsprechen. Wendet das Institut für die in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten eigene CCF-Schätzungen an, werden diese zur Berechnung des gewichteten CCF-Durchschnitts herangezogen. Wendet das Institut für die in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten keine eigenen CCF-Schätzungen an, werden die in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 aufsichtsrechtlich vorgeschriebenen CCFs verwendet. Der CCF wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt.
0110	EAD	Meldebogen C 08.01 Spalte 0110 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der Risikopositionswert.
0120	Sicherheitenwert	Meldebogen C 08.01 Spalten 0150 bis 0210 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der Marktwert der Sicherheiten.
0130	Vorrangige unbesicherte Hyp LGD ohne Negativerklärung	Artikel 161 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die hypothetischen eigenen Schätzungen der Verlustrate bei Ausfall („LGD“), die das Institut für die Risikopositionen gegenüber der Gegenpartei zugrunde legen würde, sind den folgenden Anforderungen entsprechend anzugeben: a) Der Umfang der Risikopositionen ist derselbe wie bei dem in Spalte 0150 ausgewiesenen LGD-Wert. b) Die Risikopositionen sind vorrangig und unbesichert. c) Es gilt keine Negativerklärungsklausel. Eine Negativerklärungsklausel ist eine Klausel, die festlegt, dass der Kreditnehmer oder Schuldenemittent keinen seiner Vermögenswerte bei einer anderen Partei als Sicherheit hinterlegt.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0140	Vorrangige unbesicherte Hyp LGD mit Negativerklärung	Artikel 161 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die hypothetischen eigenen LGD-Schätzungen, die das Institut für die Risikopositionen gegenüber der Gegenpartei zugrunde legen würde, sind den folgenden Anforderungen entsprechend anzugeben: a) Der Umfang der Risikopositionen ist derselbe wie bei dem in Spalte 0150 ausgewiesenen LGD-Wert. b) Die Risikopositionen sind vorrangig und unbesichert. c) Es gilt eine Negativerklärungsklausel. Eine Negativerklärungsklausel ist eine Klausel, die festlegt, dass der Kreditnehmer oder Schuldenemittent keinen seiner Vermögenswerte bei einer anderen Partei als Sicherheit hinterlegt.
0150	LGD	Meldebogen C 08.01 Spalten 0230 und 0240 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der EAD-gewichtete Durchschnitt der LGD-Werte der Risikopositionen gegenüber der Gegenpartei. Die LGDs müssen den zur Berechnung der RWEAs verwendeten LGDs entsprechen. Insbesondere müssen die LGDs für den Fall, dass das Institut von seiner zuständigen Behörde die Erlaubnis erhalten hat, eigene LGD-Schätzungen zu verwenden, auf den eigenen Schätzungen des Instituts beruhen; andernfalls müssen die LGDs auf den aufsichtsrechtlichen LGD-Werten unter Berücksichtigung der anwendbaren Risikominderung beruhen. Einzubeziehen sind auch die LGDs für beaufsichtigte große Finanzunternehmen und nicht beaufsichtigte Finanzunternehmen. Die Auswirkungen von Maßnahmen nach Artikel 458 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 sind nicht zu berücksichtigen. Der LGD wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt.
0160	Laufzeit	Meldebogen C 08.01 Spalte 0250 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist die EAD-gewichteten Laufzeit für die Risikopositionen gegenüber der Gegenpartei. Diese ist in Tagen anzugeben.
0170	RWEA	Meldebogen C 08.01 Spalte 0260 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der RWEA nach Unterstützungsfaktoren (Faktor zur Unterstützung von KMU und Faktor zur Unterstützung von Infrastruktur). Die Auswirkungen etwaiger Maßnahmen nach Artikel 458 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 werden beim RWEA nicht berücksichtigt.

C 102 – Nähere Angaben zu Risikopositionen in Portfolios mit niedrigem Ausfallrisiko

Ist der Besicherungsstatus bei den in Anhang I genannten Portfolios ein anderer als ‚Nicht zutreffend', können folgende Angaben entfallen, wenn das genehmigte Modell keine getrennten LGD-Berechnungen für die besicherten und die unbesicherten Teile einer Risikoposition umfasst: LGD (Spalte 0130), LGD ohne aufsichtliche Maßnahmen (Spalte 0131), LGD ohne Sicherheitsspanne (MoC) und aufsichtliche Maßnahmen (Spalte 0132), LGD ohne MoC, aufsichtliche Maßnahmen und Abschwungkomponente (Spalte 0133), Erwarteter Verlustbetrag (Spalte 0150) und RWEA (Spalte 0170).

Bei Portfolios, die mit dem Regelungsansatz ‚Zuordnungskriterien für Spezialfinanzierungen' definiert sind, entfallen folgende Angaben: PD (Spalte 0060), PD ohne aufsichtliche Maßnahmen (Spalte 0061), PD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen (Spalte 0062), LGD (Spalte 0130), LGD ohne aufsichtliche Maßnahmen (Spalte 0131), LGD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen (Spalte 0132), LGD ohne MoC, aufsichtliche Maßnahmen und Abschwungkomponente (Spalte 0133).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Portfolio-ID	Meldebogen C 102 Spalte 0010 in Anhang I	Anzugeben ist die Portfolio-ID für das betreffende Portfolio aus Spalte 0010 des Meldebogens C 102 in Anhang I. Diese ID ist eine Zeilenkennung und kennzeichnet im Meldebogen jeweils eine Zeile. Risikopositionen werden Portfolio-IDs nicht ausschließlich zugewiesen: Die Risikopositionen oder Teile davon sind unter jeder Portfolio-ID anzugeben, die auf den jeweiligen Fall zutrifft.
0040	Anzahl der Schuldner		Anzugeben ist die Anzahl der Schuldner, basierend auf den Schuldnern, für die entweder in Spalte 0080 oder in Spalte 0090 ein eindeutig positiver Wert ausgewiesen wird. Bei vollständiger Substitution aufgrund einer Kreditrisikominderungstechnik ist der ursprüngliche Schuldner der ‚Anzahl der Schuldner' beim ursprünglichen Portfolio und der Garantiegeber der ‚Anzahl der Schuldner' beim Garantiegeber-Portfolio hinzuzurechnen.
0060	PD	Meldebogen C 08.01 Spalte 0010 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Als PD ist der bei Berechnung des RWEA zugrunde gelegte Wert zu verwenden, wobei die Auswirkungen etwaiger, gemäß Artikel 458 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 eingeführter Maßnahmen unberücksichtigt bleiben. Für Portfolios, die einer einzelnen Ratingstufe bzw. einem einzelnen Risikopool entsprechen, ist die der jeweiligen Schuldnerklasse bzw. dem jeweiligen Pool zugewiesene PD anzugeben. Für Portfolios, die einer Kumulierung von Schuldnern unterschiedlicher Ratingstufen oder Risikopools entsprechen, ist der EAD-gewichtete Durchschnitt der PDs, die den in den kumulierten Betrag aufgenommenen Ratingstufen bzw. Risikopools zugewiesen wurden, einzutragen. Die PD wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt.
0061	PD ohne aufsichtliche Maßnahmen		Die PD ohne aufsichtliche Maßnahmen ist die PD auf Basis von Artikel 179 und 180 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, die die vom Institut vorgesehene MoC, aber keine von den zuständigen Behörden verlangten Maßnahmen (Multiplikatoren, Zuschlagsfaktoren, Untergrenzen oder ähnliche Maßnahmen, die die PD unmittelbar erhöhen) enthält. Für Portfolios, die einer einzelnen Ratingstufe bzw. einem einzelnen Risikopool entsprechen, ist die PD für die betreffende Schuldnerklasse bzw. den betreffenden Pool einschließlich der Sicherheitsspanne (MoC), aber ohne aufsichtliche Maßnahmen anzugeben. Für Portfolios, die einer Kumulierung von Schuldnern unterschiedlicher Ratingstufen oder Risikopools entsprechen, ist der EAD-gewichtete Durchschnitt der PDs der betreffenden Risikopositionen einschließlich der Sicherheitsspannen (MoCs), aber ohne aufsichtliche Maßnahmen, einzutragen. Die PD ohne aufsichtliche Maßnahmen wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt. Ist es einem Institut nicht möglich, die betreffenden konservativen Anpassungen zu isolieren, so findet Teil I Nummer 3 Anwendung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0062	PD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen		Die PD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen ist die PD, die weder die vom Institut gemäß Artikel 179 Absatz 1 Buchstabe f und Artikel 180 Absatz 1 Buchstabe e der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 vorgesehene MoC noch die Auswirkungen etwaiger von den zuständigen Behörden verlangter Maßnahmen (Multiplikatoren, Zuschlagsfaktoren, Untergrenzen oder ähnliche Maßnahmen, die die PD unmittelbar erhöhen) enthält. Für Portfolios, die einer einzelnen Ratingstufe bzw. einem einzelnen Risikopool entsprechen, ist die PD für die betreffende Schuldnerklasse bzw. den betreffenden Pool ohne MoC und ohne aufsichtliche Maßnahmen anzugeben. Für Portfolios, die einer Kumulierung von Schuldnern unterschiedlicher Ratingstufen oder Risikopools entsprechen, ist der EAD-gewichtete Durchschnitt der PDs der betreffenden Risikopositionen ohne MoCs und ohne aufsichtliche Maßnahmen anzugeben. Die PD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt. Ist es einem Institut nicht möglich, die betreffenden konservativen Anpassungen zu isolieren, so findet Teil I Nummer 3 Anwendung.
0080	Ursprungsrisiko-position vor Anwendung von Umrechnungs-faktoren	Meldebogen C 08.01 Spalte 0020 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der Ursprungsrisikopositionswert vor Berücksichtigung von Wertberichtigungen, Rückstellungen, auf Kreditrisikominderungstechniken zurückzuführenden Effekten oder Kreditumrechnungsfaktoren.
0090	Risikoposition nach Substitutions-effekten aufgrund von Kreditrisiko-minderungen (CRM) vor Anwendung von Umrechnungs-faktoren	Meldebogen C 08.01 Spalte 0090 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Angabe des Betrags, auf den Umrechnungsfaktoren (‚CCFs') angewendet werden, um die gesamte Forderungshöhe bei Ausfall (EAD) (Spalte 0110) zu erhalten. Hierbei sind Techniken der Kreditrisikominderung mit Substitutionseffekten auf die Risikoposition zu berücksichtigen.
0100	CCF	Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben ist der gewichtete Durchschnitt der CCFs. Als Gewichtungsfaktoren werden die Beträge verwendet, auf die zur Ermittlung der EAD die CCFs angewandt werden. Bei Portfolios mit Fazilitäten, die ausschließlich den in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten entsprechen, muss der gemeldete gewichtete CCF-Durchschnitt auf allen Fazilitäten beruhen. Bei Portfolios mit Fazilitäten, von denen keine unter die in Artikel 166 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten fallen, wird das CCF-Feld entweder leer gelassen oder mit der Angabe ‚NULL' versehen. Bei Portfolios mit Fazilitäten, die den in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten entsprechen, und Fazilitäten, die nicht unter die in Artikel 166 Absatz 8 der genannten Verordnung genannten Posten fallen, wird der gemeldete gewichtete CCF-Durchschnitt nur anhand der Fazilitäten ermittelt, die den in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten entsprechen. Bei der Berechnung nicht zu berücksichtigen sind insbesondere

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			die Fazilitäten, die den in Artikel 166 Absatz 10 der genannten Verordnung genannten Posten entsprechen. Wendet das Institut für die in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten eigene CCF-Schätzungen an, werden diese zur Berechnung des gewichteten CCF-Durchschnitts herangezogen. Wendet das Institut für die in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Posten keine eigenen CCF-Schätzungen an, werden die in Artikel 166 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 aufsichtsrechtlich vorgeschriebenen CCFs verwendet. Der CCF wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt.
0110	EAD	Meldebogen C 08.01 Spalte 0110 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der Risikopositionswert.
0120	Sicherheitenwert	Meldebogen C 08.01 Spalten 0150 bis 0210 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der Marktwert der Sicherheiten.
0130	LGD	Meldebogen C 08.01 Spalten 0230 und 0240 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der EAD-gewichtete Durchschnitt der LGD-Werte der Risikopositionen im jeweiligen Portfolio. Die LGDs müssen den zur Berechnung der RWEAs verwendeten LGDs entsprechen. Insbesondere müssen die LGDs für den Fall, dass das Institut von seiner zuständigen Behörde die Erlaubnis erhalten hat, eigene LGD-Schätzungen zu verwenden, auf den eigenen Schätzungen der Institute beruhen; andernfalls müssen die LGDs auf den aufsichtsrechtlichen LGD-Werten unter Berücksichtigung der anwendbaren Risikominderung beruhen. Einzubeziehen sind auch die Risikopositionen und entsprechenden LGDs für beaufsichtigte große Finanzunternehmen und nicht beaufsichtigte Finanzunternehmen. Die Auswirkungen von Maßnahmen nach Artikel 458 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 sind nicht zu berücksichtigen. Der LGD wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0131	LGD ohne aufsichtliche Maßnahmen		Die LGD ohne aufsichtliche Maßnahmen ist die LGD auf Basis von Artikel 179 und 181 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, die die vom Institut vorgesehene MoC, aber keine von den zuständigen Behörden verlangten Maßnahmen (Multiplikatoren, Zuschlagsfaktoren, Untergrenzen oder ähnliche Maßnahmen, die die LGD unmittelbar erhöhen) enthält. Für Portfolios, die einer einzelnen Ratingstufe bzw. einem einzelnen Risikopool entsprechen, ist die LGD für die betreffende Schuldnerklasse bzw. den betreffenden Pool einschließlich der Sicherheitsspanne (MoC), aber ohne aufsichtliche Maßnahmen anzugeben. Für Portfolios, die einer Kumulierung von Schuldnern unterschiedlicher Ratingstufen oder Risikopools entsprechen, ist der EAD-gewichtete Durchschnitt der LGDs der betreffenden Risikopositionen einschließlich der Sicherheitsspannen (MoCs), aber ohne aufsichtliche Maßnahmen, einzutragen. Die LGD ohne aufsichtliche Maßnahmen wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt. Ist es einem Institut nicht möglich, die betreffenden konservativen Anpassungen zu isolieren, so findet Teil I Nummer 3 Anwendung.
0132	LGD ohne MoC und ohne aufsichtliche Maßnahmen		Die LGD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen ist die LGD, die weder die vom Institut gemäß Artikel 179 Absatz 1 Buchstabe f und Artikel 181 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 vorgesehene MoC noch die Auswirkungen etwaiger von den zuständigen Behörden verlangter Maßnahmen (Multiplikatoren, Zuschlagsfaktoren, Untergrenzen oder ähnliche Maßnahmen, die die LGD unmittelbar erhöhen) enthält. Für Portfolios, die einer einzelnen Ratingstufe bzw. einem einzelnen Risikopool entsprechen, ist die LGD für die betreffende Schuldnerklasse bzw. den betreffenden Pool ohne MoC und ohne aufsichtliche Maßnahmen anzugeben. Für Portfolios, die einer Kumulierung von Schuldnern unterschiedlicher Ratingstufen oder Risikopools entsprechen, ist der EAD-gewichtete Durchschnitt der LGDs der betreffenden Risikopositionen ohne MoCs und ohne aufsichtliche Maßnahmen anzugeben. Die LGD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt. Ist es einem Institut nicht möglich, die betreffenden konservativen Anpassungen zu isolieren, so findet Teil I Nummer 3 Anwendung.
0133	LGD ohne MoC, aufsichtliche Maßnahmen und Abschwung-komponente		Die LGD ohne MoC, aufsichtliche Maßnahmen und Abschwungkomponente ist die LGD, die weder die vom Institut gemäß Artikel 179 Absatz 1 Buchstabe f und Artikel 181 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 vorgesehene Sicherheitsspanne MoC, noch die Auswirkungen etwaiger von den zuständigen Behörden verlangter Maßnahmen (Multiplikatoren, Zuschlagsfaktoren, Untergrenzen oder ähnliche Maßnahmen, die die LGD unmittelbar erhöhen), noch die nach Artikel 181 Absatz 1 Buchstabe b jener Verordnung vorgeschriebene Abschwungkomponente enthält. Für Portfolios, die einer einzelnen Ratingstufe bzw. einem einzelnen Risikopool entsprechen, ist die LGD für die betreffende Schuldnerklasse bzw. den betreffenden Pool ohne MoC, ohne aufsichtliche Maßnahmen und ohne Abschwungkomponente anzugeben. Für Portfolios, die einer Kumulierung von Schuldnern unterschiedlicher Ratingstufen oder Risikopools entsprechen, ist der EAD-gewichtete Durchschnitt der LGDs der betreffenden Risikopositionen ohne MoCs, ohne aufsichtliche Maßnahmen und ohne Abschwungkomponente anzugeben.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			Die LGD ohne MoC, ohne aufsichtliche Maßnahmen und ohne Abschwungkomponente wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt. Ist es einem Institut nicht möglich, die betreffenden konservativen Anpassungen zu isolieren, so findet Teil I Nummer 3 Anwendung.
0140	Laufzeit	Meldebogen C 08.01 Spalte 0250 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451	Angabe der EAD-gewichteten Laufzeit. Diese ist in Tagen anzugeben. Diese Informationen werden nicht für Risikopositionen gemeldet, bei denen die Restlaufzeit nicht in die Berechnung der RWEAs einfließt. Insbesondere ist die Laufzeit nicht für Portfolios aus Risikopositionen der Risikopositionsklasse ‚Mengengeschäft' anzugeben.
0150	Erwarteter Verlustbetrag	Meldebogen C 08.01 Spalte 0280 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Angabe des erwarteten Verlustbetrags.
0160	Rückstellungen für ausgefallene Risikopositionen	Meldebogen C 09.02 Spalten 0050, 0055 und 0060 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben sind die Rückstellungen für ausgefallene Risikopositionen. Dazu gehören auch alle allgemeinen und spezifischen Kreditrisikoanpassungen für ausgefallene Risikopositionen im Sinne von Artikel 110 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. (Einmalige) Kreditrisikoanpassungen, die ein Institut im Zusammenhang mit den Änderungen bei der Implementierung der Ausfalldefinition (DoD) vornimmt, werden so gemeldet, wie sie in der Datenbank des Instituts registriert werden.
0170	RWEA	Meldebogen C 08.01 Spalte 0260 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der RWEA nach Unterstützungsfaktoren (Faktor zur Unterstützung von KMU und Faktor zur Unterstützung von Infrastruktur). Die Auswirkungen etwaiger Maßnahmen nach Artikel 458 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 werden beim RWEA nicht berücksichtigt.
0180	Standardisierte RWEA	Teil 3 Titel II Kapitel 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Der standardisierte RWEA ist der hypothetische RWEA, den man erhält, wenn auf die Risikopositionen anstelle des IRB-Ansatzes der Standardansatz für Kreditrisiken angewandt wird.

C 103 – Nähere Angaben zu Risikopositionen in Portfolios mit hohem Ausfallrisiko

Ist der Besicherungsstatus bei den in Anhang I genannten Portfolios ein anderer als ‚Nicht zutreffend', können folgende Angaben entfallen, wenn das genehmigte Modell keine getrennten LGD-Berechnungen für die besicherten und die unbesicherten Teile einer Risikoposition umfasst: LGD (Spalte 0130), LGD ohne aufsichtliche Maßnahmen (Spalte 0131), LGD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen (Spalte 0132), LGD ohne MoC, aufsichtliche Maßnahmen und Abschwungkomponente (Spalte 0133), Erwarteter Verlustbetrag (Spalte 0150), RWEA (Spalte 0170), Verlustrate des letzten Jahres (Spalte 0210) und Verlustrate der letzten 5 Jahre (Spalte 0220).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Portfolio-ID		Anzugeben ist die Portfolio-ID für das betreffende Portfolio aus Spalte 0010 des Meldebogens C 103 in Anhang I. Diese ID ist eine Zeilenkennung und kennzeichnet im Meldebogen jeweils eine Zeile. Risikopositionen werden Portfolio-IDs nicht ausschließlich zugewiesen: Die Risikopositionen oder Teile davon sind unter jeder Portfolio-ID anzugeben, die auf den jeweiligen Fall zutrifft.
0040	Anzahl der Schuldner		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0040 in Anhang I.
0060	PD		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0060 in Anhang I.
0061	PD ohne aufsichtliche Maßnahmen		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0061 in Anhang I.
0062	PD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0062 in Anhang I.
0080	Ursprungsrisiko-position vor Anwendung von Umrechnungs-faktoren		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0080 in Anhang I.
0090	Risikoposition nach Substitutions-effekten aufgrund von Kreditrisiko-minderungen vor Anwendung von Umrechnungs-faktoren		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0090 in Anhang I.
0100	CCF		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0100 in Anhang I.
0110	EAD		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0110 in Anhang I.
0120	Sicherheitenwert		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0120 in Anhang I.
0130	LGD		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0130 in Anhang I.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0131	LGD ohne aufsichtliche Maßnahmen		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0131 in Anhang I.
0132	LGD ohne MoC und ohne aufsichtliche Maßnahmen		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0132 in Anhang I.
0133	LGD ohne MoC, aufsichtliche Maßnahmen und Abschwung-komponente		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0133 in Anhang I.
0140	Laufzeit		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0140 in Anhang I.
0150	Erwarteter Verlustbetrag		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0150 in Anhang I.
0160	Rückstellungen für ausgefallene Risikopositionen		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0160 in Anhang I.
0170	RWEA		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0170 in Anhang I.
0180	Standardisierte RWEA		Siehe Erläuterungen zu Meldebogen C 102 Spalte 0180 in Anhang I.
0190	Ausfallrate des letzten Jahres		Angabe der Ausfallrate des letzten Jahres. Hierfür wird die Ausfallrate definiert als das Verhältnis zwischen folgenden Werten: a) der Summe der Risikopositionen (Ursprungsrisikoposition, Spalte 0080, bemessen am Stichtag minus einem Jahr), die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren und im Zeitraum zwischen dem Stichtag minus einem Jahr und dem Stichtag ausgefallen sind, b) der Summe der Risikopositionen (Ursprungsrisikoposition, Spalte 0080, bemessen am Stichtag minus einem Jahr), die am Stichtag minus einem Jahr nicht ausgefallen waren. Neue Risikopositionen, die während des Jahres vor dem Stichtag aufgebaut wurden, werden nicht berücksichtigt. Risikopositionen, die während des Jahres vor dem Stichtag ausgefallen sind, aber im selben Jahr wieder vertragsgemäß bedient wurden, werden sowohl im Zähler als auch im Nenner berücksichtigt. Mehrfache Ausfälle desselben Schuldners sind nur einmal einzubeziehen.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			Diese Angaben sind nur für Portfolio-IDs erforderlich, die sich auf Risikopositionen mit dem Status ‚Nicht ausgefallen' beziehen, und als Wert zwischen 0 und 1 auszudrücken. Heranzuziehen sind die Ausfälle und Ausfalldaten, die unter Implementierung der zum Ereigniszeitpunkt geltenden DoD registriert werden, d. h. ein Institut stellt einen Ausfall auf Basis der DoD fest, die vom Institut angewandt wurde, als das Ereignis registriert wurde. Änderungen der DoD sind erst ab dem Datum ihrer Implementierung zu berücksichtigen; eine rückwirkende Anwendung von Änderungen der DoD nach dem jeweiligen Ausfallereignis (Rückwärtssimulation) ist nicht zulässig.
0200	Ausfallrate der letzten 5 Jahre		Angabe der gewichteten durchschnittlichen Ausfallraten der letzten fünf Jahre vor dem Stichtag. Dabei ist die in Spalte 0190 enthaltene Definition der Ausfallrate anzuwenden. Als Gewichte sind die nicht ausgefallenen Risikopositionen, die in die Berechnung der Ausfallrate gemäß Spalte 0190 eingeflossen sind, zu verwenden. Ist das Institut im Rahmen von Artikel 180 Absatz 1 Buchstabe h oder Artikel 180 Absatz 2 Buchstabe e der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 nicht verpflichtet, eine Ausfallrate für die letzten fünf Jahre vor dem Stichtag zu berechnen, so entwickelt es einen Näherungswert, der sich auf die am weitesten und bis zu fünf Jahre vor dem Stichtag zurückreichenden Daten stützt, und legt der zuständigen Behörde Unterlagen vor, in der die Berechnung detailliert aufgeführt wird. Diese Angaben sind nur für Portfolio-IDs erforderlich, die sich auf Risikopositionen mit dem Status ‚Nicht ausgefallen' beziehen, und als Wert zwischen 0 und 1 auszudrücken. Heranzuziehen sind die Ausfälle und Ausfalldaten, die unter Implementierung der zum Ereigniszeitpunkt geltenden DoD registriert werden, d. h. ein Institut stellt einen Ausfall auf Basis der DoD fest, die vom Institut angewandt wurde, als das Ereignis registriert wurde. Änderungen der DoD sind erst ab dem Datum ihrer Implementierung zu berücksichtigen; eine rückwirkende Anwendung von Änderungen der DoD nach dem jeweiligen Ausfallereignis (Rückwärtssimulation) ist nicht zulässig.
0210	Verlustrate des letzten Jahres		Die Verlustrate des letzten Jahres ist nur für Portfolio-IDs anzugeben, die sich auf Risikopositionen mit dem Status ‚Nicht ausgefallen' und ‚Ausgefallen' beziehen. Bei nicht ausgefallenen Portfolios ist die Verlustrate die Summe der innerhalb des Jahres vor dem Stichtag vorgenommenen Kreditrisikoanpassungen und Abschreibungen für Risikopositionen, die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren und im Jahr vor dem Stichtag ausgefallen sind, geteilt durch die Summe der genau ein Jahr vor dem Stichtag gemessenen EAD für Risikopositionen, die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren und im Jahr vor dem Stichtag ausgefallen sind.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			Im Zähler der Verlustrate werden sämtliche Kreditrisikoanpassungen und Abschreibungen im Zusammenhang mit den im Jahr vor dem Stichtag ausgefallenen Risikopositionen berücksichtigt, einschließlich der vor dem Zeitpunkt des Ausfalls angewandten Kreditrisikoanpassungen. Neue Risikopositionen, die während des Jahres vor dem Stichtag aufgebaut wurden, werden nicht berücksichtigt. Risikopositionen, die während des Jahres vor dem Stichtag ausgefallen sind, aber im selben Jahr wieder vertragsgemäß bedient wurden, werden im Nenner der Verlustrate, und Kreditrisikoanpassungen sowie Abschreibungen auf diese Risikopositionen im Zähler der Verlustrate berücksichtigt. Mehrfache Ausfälle desselben Schuldners sind nur einmal zu berücksichtigen. Für ausgefallene Portfolios werden bei der Verlustrate die Risikopositionen berücksichtigt, die genau ein Jahr vor dem Stichtag ausgefallen waren. Sie entspricht der Summe aus a) den Kreditrisikoanpassungen bei diesen Risikopositionen ein Jahr vor dem Stichtag und b) den Kreditrisikoanpassungen und Abschreibungen, die innerhalb des Jahres vor dem Stichtag vorgenommen wurden, geteilt durch die Summe der genau ein Jahr vor dem Stichtag für die betreffenden Risikopositionen gemessenen EAD. Neue Ausfälle im Jahr vor dem Stichtag werden nicht berücksichtigt. Risikopositionen, die im Jahr vor dem Stichtag wieder vertragsgemäß bedient wurden, fließen in den Nenner der Verlustrate, Kreditrisikoanpassungen sowie Abschreibungen auf diese Risikopositionen in den Zähler der Verlustrate ein. Mehrfache Ausfälle desselben Schuldners sind nur einmal einzubeziehen. Die Verlustrate wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt. Heranzuziehen sind die Ausfälle und Ausfalldaten, die unter Implementierung der zum Ereigniszeitpunkt geltenden DoD registriert werden, d. h. ein Institut stellt einen Ausfall auf Basis der DoD fest, die vom Institut angewandt wurde, als das Ereignis registriert wurde. Änderungen der DoD sind erst ab dem Datum ihrer Implementierung zu berücksichtigen; eine rückwirkende Anwendung von Änderungen der DoD nach dem jeweiligen Ausfallereignis (Rückwärtssimulation) ist nicht zulässig.
0220	Verlustrate der letzten 5 Jahre		Der EAD-gewichtete Durchschnitt der Verlustraten in den letzten fünf Jahren vor dem Stichtag ist nur für Portfolio-IDs anzugeben, die sich auf Risikopositionen mit dem Status ‚Nicht ausgefallen' und ‚Ausgefallen' beziehen. Siehe Definition der Verlustrate in Spalte 0210. Die Verlustrate der letzten fünf Jahre wird auf Basis der jährlichen Verlustraten der letzten fünf Jahre bestimmt, sofern diese jährlichen Verlustraten analog zur Definition der Verlustrate in Spalte 0210 definiert sind; insbesondere dürfen die jährlichen Verlustraten keine zusätzlichen Veränderungen der Kreditrisikoanpassungen und Abschreibungen enthalten, die nach dem Beobachtungszeitraum (Kalenderjahr) der jeweiligen jährlichen Verlustrate eingetreten sind. Ist das Institut im Rahmen von Artikel 181 Absatz 2 letzter Unterabsatz der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 nicht verpflichtet, Daten für die letzten fünf Jahre vor dem Stichtag heranzuziehen, so entwickelt es einen Näherungswert, der sich auf die am weitesten und bis zu fünf Jahre vor dem Stichtag zurückreichenden Daten stützt, und legt der zuständigen Behörde Unterlagen vor, in der die Berechnung detailliert aufgeführt wird. Die Verlustrate wird als Wert zwischen 0 und 1 ausgedrückt. Heranzuziehen sind die Ausfälle und Ausfalldaten, die unter Implementierung der zum Ereigniszeitpunkt geltenden DoD registriert werden, d. h. ein Institut stellt einen Ausfall auf Basis der DoD fest, die vom Institut angewandt wurde, als das Ereignis registriert wurde. Änderungen der DoD sind erst ab dem Datum ihrer Implementierung zu berücksichtigen; eine rückwirkende Anwendung von Änderungen der DoD nach dem jeweiligen Ausfallereignis (Rückwärtssimulation) ist nicht zulässig.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0250	RWEA-		Die Institute berechnen und melden RWEA- für die in Anhang I Meldebogen 103 genannten Portfolios mit den folgenden Portfolio-IDs: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWEA- ist der hypothetische RWEA nach Anwendung von Unterstützungsfaktoren, der sich aus der Anwendung der PD--Werte anstelle der PD-Werte des Instituts für jede Risikoposition ergibt. Die übrigen Parameter, die bei der Berechnung benötigt werden, dürfen nicht geändert werden. PD- basiert auf einer getrennten Berechnung für jede Ratingstufe. Zu verwenden sind die Ratingstufen aus Spalte 0005 von Meldebogen C 08.02 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451 der Kommission (Erläuterungen siehe Meldebogen C 08.01 Spalte 0010 und Meldebogen C 08.02 in Anhang II der genannten Verordnung). Bei jeder Ratingstufe ist p^- der kleinste positive Wert, der die Gleichung erfüllt: $$p^- + \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^- \bullet (1-p^-)}{n}} \geq DR_{1y}$$ wobei $DR_{1y} > 0$, und $p^- = 0$, wobei $DR_{1y} = 0$. Dabei gilt: Φ^{-1} = Umkehrfunktion der (kumulativen) Standardnormalverteilung; q = Konfidenzniveau von 90 %; DR_{1y} = fallgewichtete Ausfallrate des dem Stichtag vorausgehenden Jahres, d. h. die Zahl der Schuldner, die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren, unter die betreffende Ratingstufe fielen und im Laufe des letzten Jahres ausgefallen sind, geteilt durch die Anzahl der Schuldner, die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren und unter die betreffende Ratingstufe fielen; n = Zahl der Schuldner, die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren und unter die betreffende Ratingstufe fielen. PD- ist bei jedem Schuldner gleich p^-, wobei p^- nach der Formel in Unterabsatz 4 für die dem Schuldner zugeordnete Ratingstufe berechnet wird.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0260	RWEA+		Die Institute berechnen und melden RWEA+ für die in Anhang I Meldebogen 103 genannten Portfolios mit den folgenden Portfolio-IDs: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWEA+ ist der hypothetische RWEA nach Anwendung von Unterstützungsfaktoren, der sich aus der Anwendung der PD +-Werte anstelle der PD-Werte des Instituts für jede Risikoposition ergibt. Die übrigen Parameter, die bei der Berechnung benötigt werden, dürfen nicht geändert werden. PD+ basiert auf einer getrennten Berechnung für jede Ratingstufe. Zu verwenden sind die Ratingstufen aus Spalte 0005 von Meldebogen C 08.02 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451 der Kommission (Erläuterungen siehe Meldebogen C 08.01 Spalte 0010 und Meldebogen C 08.02 in Anhang II der genannten Verordnung). Für jede Ratingstufe ist p^+ der größte positive Wert, der die Gleichung erfüllt: $$p^+ - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^+ \bullet (1-p^+)}{n}} \leq DR_{1y}$$ Dabei gilt: Φ^{-1} = Umkehrfunktion der (kumulativen) Standardnormalverteilung; q = Konfidenzniveau von 90 %; DR_{1y} = fallgewichtete Ausfallrate des dem Stichtag vorausgehenden Jahres, d. h. die Zahl der Schuldner, die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren, unter die betreffende Ratingstufe fielen und im Laufe des letzten Jahres ausgefallen sind, geteilt durch die Anzahl der Schuldner, die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren und unter die betreffende Ratingstufe fielen; n = Zahl der Schuldner, die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren und unter die betreffende Ratingstufe fielen. PD+ ist bei jedem Schuldner gleich p^+, wobei p^+ nach der Formel in Unterabsatz 4 für die dem Schuldner zugeordnete Ratingstufe berechnet wird.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0270	RWEA--		Die Institute berechnen und melden RWEA-- für die in Anhang I Meldebogen 103 genannten Portfolios mit den folgenden Portfolio-IDs: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWEA-- ist der hypothetische RWEA nach Anwendung von Unterstützungsfaktoren, der sich aus der Anwendung der PD--Werte anstelle der PD-Werte des Instituts für jede Risikoposition ergibt. Die übrigen Parameter, die bei der Berechnung benötigt werden, dürfen nicht geändert werden. PD-- basiert auf einer getrennten Berechnung für jede Ratingstufe. Zu verwenden sind die Ratingstufen aus Spalte 0005 von Meldebogen C 08.02 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451 der Kommission (Erläuterungen siehe Meldebogen C 08.01 Spalte 0010 und Meldebogen C 08.02 in Anhang II der genannten Verordnung). Bei jeder Ratingstufe ist p^{--} der kleinste positive Wert, der die Gleichung erfüllt: $$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{-} \bullet (1-p^{-})}{n}} \geq DR_{5y}$$ wobei $DR_{5y} > 0$, und $p^{-} := 0$, wobei $DR_{5y} = 0$ Dabei gilt: Φ^{-1} = Umkehrfunktion der (kumulativen) Standardnormalverteilung; q = Konfidenzniveau von 90 %; DR_{5y} = Ausfallrate der letzten fünf Jahre in der Ratingstufe, berechnet als einfacher Durchschnitt von fünf fallspezifisch gewichteten Einjahres-Ausfallraten; n = Zahl der Schuldner, die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren und unter die betreffende Ratingstufe fielen. PD-- ist bei jedem Schuldner gleich p^{--}, wobei p^{--} nach der Formel in Unterabsatz 4 für die dem Schuldner zugeordnete Ratingstufe berechnet wird.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0280	RWEA++		Die Institute berechnen und melden RWEA++ für die in Anhang I Meldebogen 103 genannten Portfolios mit den folgenden Portfolio-IDs: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWEA++ ist der hypothetische RWEA nach Anwendung von Unterstützungsfaktoren, der sich aus der Anwendung der PD++-Werte anstelle der PD-Werte des Instituts für jede Risikoposition ergibt. Die übrigen Parameter, die bei der Berechnung benötigt werden, dürfen nicht geändert werden. PD++ basiert auf einer getrennten Berechnung für jede Ratingstufe. Zu verwenden sind die Ratingstufen aus Spalte 0005 von Meldebogen C 08.02 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451 der Kommission (Erläuterungen siehe Meldebogen C 08.01 Spalte 0010 und Meldebogen C 08.02 in Anhang II der genannten Verordnung). Für jede Ratingstufe ist p^{++} der größte positive Wert, der die Gleichung erfüllt: $$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{++} \cdot (1-p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$ Dabei gilt: Φ^{-1} = Umkehrfunktion der (kumulativen) Standardnormalverteilung; q = Konfidenzniveau von 90 %; DR_{5y} = Ausfallrate der letzten fünf Jahre in der Ratingstufe, berechnet als einfacher Durchschnitt von fünf fallspezifisch gewichteten Einjahres-Ausfallraten; n = Zahl der Schuldner, die genau ein Jahr vor dem Stichtag nicht ausgefallen waren und unter die betreffende Ratingstufe fielen. PD++ ist bei jedem Schuldner gleich p^{++}, wobei p^{++} nach der Formel in Unterabsatz 4 für die dem Schuldner zugeordnete Ratingstufe berechnet wird.

C 105.01 – Bestimmung interner Modelle

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	ID des internen Modells		Das Institut muss die von der zuständigen Behörde zugewiesene ID des internen Modells angeben. Ist das nicht möglich, gibt das Institut die selbst zugewiesene ID des internen Modells an. Bei der ID des internen Modells muss es sich um eine eindeutige Kennung für ein von der zuständigen Behörde genehmigtes und für die Berechnung der RWEA verwendetes internes Modell handeln. Sie ist eine Zeilenkennung und kennzeichnet im Meldebogen jeweils eine Zeile.
0020	Bezeichnung des Modells		Anzugeben ist die vom berichtenden Institut vergebene Modellbezeichnung des internen Modells.
0030	IRBA-Risikoparameter		Auszuwählen ist einer der folgenden IRBA-Risikoparameter: a) PD; b) LGD; c) CCF. Im Falle eines internen Modells für ‚Unternehmen – Spezialfinanzierungspositionen' im Sinne von Artikel 153 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (‚Zuordnungskriterien für Spezialfinanzierungsrisikopositionen') wird das Feld leer gelassen oder mit der Angabe ‚NULL' versehen.
0040	EAD	Meldebogen C 08.01 Spalte 0110 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der aggregierte Risikopositionswert für die dem jeweiligen Ratingmodell unterliegenden Risikopositionen.
0050	EAD-gewichtete durchschnittliche Ausfallrate zur Kalibrierung		Angabe des zur Kalibrierung der PD-Modelle verwendeten EAD-gewichteten Durchschnitts der jährlichen Ausfallraten. Diese Angaben sind nur für PD-Modelle auszufüllen. Auch die bei der Kalibrierung der Modellparameter verwendeten Daten sind anzugeben. Sind keine internen Daten vorhanden und stützt sich die Kalibrierung auf externe Daten, so sind diese externen Daten anzugeben.
0060	Fallspezifisch gewichtete durchschnittliche Ausfallrate zur Kalibrierung		Angabe des einfachen Durchschnitts der zur Kalibrierung der PD-Modelle verwendeten fallspezifisch gewichteten jährlichen Ausfallraten. Diese Angaben sind nur für PD-Modelle auszufüllen. Auch die bei der Kalibrierung der Modellparameter verwendeten Daten sind anzugeben. Sind keine internen Daten vorhanden und stützt sich die Kalibrierung auf externe Daten, so sind diese externen Daten anzugeben.
0070	Langfristige PD		Angabe der zentralen Tendenz, die alle auf den einfachen fallspezifisch gewichteten Durchschnitt der jährlichen Ausfallraten angewandten vorsichtigen Berichtigungen umfasst und die das Institut zur Kalibrierung der PD-Modelle verwendet hat. Diese Angaben sind nur für PD-Modelle auszufüllen.
0080	Gesundungsrate ausgefallener Vermögenswerte		Die Gesundungsrate ausgefallener Vermögenswerte ist der prozentuale Anteil der ausstehenden ausgefallenen Positionen, die innerhalb von zwölf Monaten in den Status ‚nicht ausgefallen' zurückkehren. Institute, die für das jeweilige Modell keine Gesundungsraten berechnen, berechnen auf Grundlage der vorstehenden Definition einen Näherungswert. Das Institut muss der zuständigen Behörde mitteilen, dass es einen solchen Näherungswert verwendet. Diese Angabe ist nur für LGD-Modelle erforderlich.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0090	Erlösquote bei zwangs-vollstreckten, nicht gesundeten Vermögens-werten		Angabe der fallspezifisch gewichteten durchschnittlichen Erlösquote bei nicht gesundeten Ausfällen, die das Institut für die Zeitreihen zur Kalibrierung der LGD-Modelle für nicht ausgefallene Vermögenswerte verwendet. Auch die bei der Kalibrierung der Modellparameter verwendeten Daten sind anzugeben. Sind keine internen Daten vorhanden und stützt sich die Kalibrierung auf externe Daten, so sind diese externen Daten anzugeben. Institute, die aufgrund eines nicht abgeschlossenen Verwertungsverfahrens keine spezifische Erlösquote für nicht gesundete Ausfälle haben, berechnen einen Näherungswert, wobei sie sowohl die tastsächlich erzielten Erlöse als auch die geschätzten Erlöse aus noch nicht abgeschlossenen Abwicklungsprozessen berücksichtigen. Das Institut muss der zuständigen Behörde mitteilen, dass es einen solchen Näherungswert verwendet. Diese Angabe ist nur für LGD-Modelle erforderlich.
0100	Dauer des Verwertungs-zeitraums bei zwangs-vollstreckten, nicht gesundeten Aktiva		Angabe der fallspezifisch gewichteten durchschnittlichen Dauer des Verwertungszeitraums (zwischen dem Ausfallzeitpunkt und dem Abschluss des Verwertungsverfahrens) bei den nicht gesundeten Ausfällen, die das Institut in die Zeitreihen für die Kalibrierung der LGD-Modelle für nicht ausgefallene Vermögenswerte aufgenommen hat. Die fallgewichtete durchschnittliche Dauer ist in Tagen anzugeben. Auch die bei der Kalibrierung der Modellparameter verwendeten Daten sind anzugeben. Sind keine internen Daten vorhanden und stützt sich die Kalibrierung auf externe Daten, so sind diese externen Daten anzugeben. Institute, denen aufgrund eines unvollständigen Verwertungsverfahrens keine spezifischen Daten zur Länge des Verwertungsverfahrens bei nicht gesundeten Ausfällen vorliegen, müssen unter Berücksichtigung der gelieferten Definition einen Näherungswert berechnen. Das Institut muss der zuständigen Behörde mitteilen, dass es einen solchen Näherungswert verwendet. Diese Angabe ist nur für LGD-Modelle erforderlich.
0110	Gemeinsame Entscheidung	Artikel 20 Absatz 2 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Das Institut gibt an, ob hinsichtlich der Genehmigung, bei der Berechnung der Aufsichtsanforderungen für von den Tochterunternehmen des Instituts in den gemeldeten Referenzportfolios gehaltenen Risikopositionen den IRB-Ansatz zu verwenden, eine gemeinsame Entscheidung der konsolidierenden Behörde und der zuständigen Behörde des Aufnahmelandes über Aufsichtsanforderungen vorliegt.
0120	Konsolidierende Aufsichtsbehörde	Artikel 20 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe des ISO-Ländercodes des Herkunftslandes der Behörde, die für die konsolidierte Beaufsichtigung des Instituts, das einen IRB-Ansatz verwendet, zuständig ist.
0130	RWEA	Meldebogen C 08.01 Spalte 0260 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der aggregierte RWEA nach Unterstützungsfaktoren (Faktoren zur Unterstützung von KMU und Infrastruktur) für die dem jeweiligen Ratingmodell unterliegenden Risikopositionen.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0140	RWEA-Zuschlags-faktoren		Die RWEA-Zuschlagsfaktoren sind Unterposten (‚davon') des RWEA (Spalte 0130 von Meldebogen C 105.01) und beinhalten: a) den RWEA, der zu dem aus der Anwendung des/der Risikoparameter des Modells resultierenden RWEA hinzuaddiert wird, falls etwaige zusätzliche interne Sicherheitsmaßnahmen unmittelbar auf den RWEA angewandt werden; b) den RWEA, der zu dem aus der Anwendung des/der Risikoparameter des Modells resultierenden RWEA hinzuaddiert wird, falls aufsichtliche Maßnahmen unmittelbar auf den RWEA angewandt werden. Die unter den Buchstaben a und b genannten Beträge enthalten keine Maßnahmen, die bereits in den Feldern PD (Spalte 0060 der Meldebögen C 102 und C 103), CCF (Spalte 0100 der Meldebögen C 102 und C 103) oder LGD (Spalte 0130 der Meldebögen C 102 und C 103) abgebildet sind, sondern beschränken sich auf Maßnahmen, die unmittelbar auf den RWEA angewandt werden und gegebenenfalls zu den Sicherheitsspannen und aufsichtlichen Maßnahmen (Multiplikatoren, Zuschläge, Untergrenzen u. Ä.), die die Risikoparameter erhöhen, hinzukommen. Die Auswirkungen etwaiger Maßnahmen nach Artikel 458 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 werden bei den RWEA-Zuschlägen nicht berücksichtigt. Ist es einem Institut nicht möglich, die betreffenden konservativen Anpassungen zu isolieren, so findet Teil I Nummer 3 Anwendung.

C 105.02 – Zuordnung interner Modelle zu Portfolios

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Portfolio-ID	Meldebogen C 102 Spalte 0010 und Meldebogen C 103 Spalte 0010	Anzugeben ist die Portfolio-ID als eindeutige Kennung des Portfolios aus den Meldebögen C 102 und 103 in Anhang I. Die Spalten 0010 und 0020 bilden eine zusammengesetzte Zeilenkennung und bezeichnen als solche in diesem Meldebogen jeweils eine Zeile.
0020	ID des internen Modells	Meldebogen C 105.01 Spalte 0010	Anzugeben ist die vom meldenden Institut zugewiesene ID des internen Modells. Die Spalten 0010 und 0020 bilden eine zusammengesetzte Zeilenkennung und bezeichnen als solche im Meldebogen C 105.02 jeweils eine Zeile.
0030	EAD	Meldebogen C 08.01 Spalte 0110 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der aggregierte Risikopositionswert für die Risikopositionen, die in dem in Spalte 0010 definierten Portfolio enthalten sind und dem in Spalte 0020 definierten Ratingmodell unterliegen. Wird bei allen Risikopositionen eines Portfolios nach einem spezifischen Modell verfahren, muss der Risikopositionswert dem Betrag entsprechen, der für dasselbe Portfolio in Spalte 0110 des Meldebogens C 102 bzw. C 103 angegeben wird.
0040	RWEA	Meldebogen C 08.01 Spalte 0260 in Anhang I der Durchführungs-verordnung (EU) 2021/451	Anzugeben ist der aggregierte RWEA nach Unterstützungsfaktoren für die Risikopositionen, die in dem in Spalte 0010 definierten Portfolio enthalten sind und dem in Spalte 0020 definierten Ratingmodell unterliegen. Wird bei allen Risikopositionen eines Portfolios nach einem spezifischen Modell verfahren, muss der RWEA dem Betrag entsprechen, der für dasselbe Portfolio in Spalte 0170 des Meldebogens C 102 bzw. C 103 angegeben wird.

C 105.03 – Zuordnung interner Modelle zu Ländern

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0005	Zeilen-ID		Dieser Code ist eine Zeilenkennung und kennzeichnet im Meldebogen jeweils eine Zeile. Die Angaben folgen der numerischen Reihenfolge 1, 2, 3 usw.
0010	ID des internen Modells	Meldebogen C 105.01 Spalte 0010	Anzugeben ist die vom meldenden Institut zugewiesene ID des internen Modells. Ist eine ID des internen Modells mit mehreren Ländern verbunden, sind für jede Kombination aus ‚ID des internen Modells' und ‚Standort des Instituts' getrennte Zeilen auszufüllen. Die Spalten 0010 und 0020 bilden eine zusammengesetzte Zeilenkennung und bezeichnen als Kombination in der Tabelle jeweils eine Zeile.
0020	Standort des Instituts	Artikel 20 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe des ISO-Ländercodes des Sitzlands jedes Tochterunternehmens, in dem in den einzelnen Referenzportfolios IRB-Risikopositionen gebucht werden, unabhängig davon, ob eine Genehmigung der Aufsichtsbehörde des Aufnahmelandes für die Anwendung eines IRB-Ansatzes vorliegt."

ANHANG II

„*ANHANG V*

REFERENZINSTRUMENTE UND -PORTFOLIOS ‚MARKTRISIKO‘

Abschnitt 1:
Erläuterungen

Abschnitt 2:
Instrumente

Abschnitt 3:
Einzelne Portfolios – Einzelnes Instrument

Abschnitt 4:
Einzelne Portfolios – Mehrere Instrumente

Abschnitt 5:
Aggregierte Portfolios

Abschnitt 6:
Instrumente – zusätzliche Spezifikationen

Abschnitt 7:
SBM-Validierungsportfolios

Abschnitt 1: Erläuterungen

a) Für die Zwecke dieses Anhangs gelten folgende Begriffsbestimmungen:

i) ‚Buchungsdatum': Datum und Zeitpunkt, zu dem die Institute die Transaktionen für die Zwecke des Benchmarkings buchen;

ii) ‚Ursprüngliche Marktbewertung (‚IMV'): Mark-to-Market-Wert der in Abschnitt 2 dieses Anhangs genannten Instrumente zum IMV-Referenzdatum und -zeitpunkt;

iii) ‚IMV-Referenzdatum': Datum und Zeitpunkt, zu dem die Institute die IMV der Transaktionen im Benchmarking-Portfolio feststellen;

iv) ‚IMV-Einreichungstermin': Datum, bis zu dem die Institute die IMV-Ergebnisse für die Transaktionen im Benchmarking-Portfolio einreichen müssen;

v) ‚VaR': Value at Risk (Risikopotenzial);

vi) ‚sVaR': Stressed Value at Risk (Risikopotenzial unter Stressbedingungen);

vii) ‚IRC': Incremental Risk Charge (Ansatz für zusätzliche Risiken);

viii) ‚CTP': Correlation Trading Portfolio (Korrelationshandelsportfolio);

ix) ‚APR': All Price Risk (alle Preisrisiken abbildende Zahl), berechnet nach Artikel 377 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013;

x) ‚Risikomessgrößen' (‚RM'): Wert von VaR, sVaR und, falls erforderlich, IRC und APR für die Portfolios, gemäß den Abschnitten 3, 4 und 5 dieses Anhangs, zwischen dem ersten und dem letzten RM-Referenzdatum;

xi) ‚Erstes RM-Referenzdatum': Datum, an dem die Institute mit der Berechnung der RM-Werte beginnen;

xii) ‚Letztes RM-Referenzdatum': Datum, an dem die Institute die Berechnung der RM-Werte beenden;

xiii) ‚RM-Einreichungstermin': Datum, bis zu dem die Institute die RM-Ergebnisse für die Transaktionen im Benchmarking-Portfolio einreichen müssen;

xiv) ‚Barwert' (‚PV'): Mark-to-Market-Wert der in Abschnitt 3 dieses Anhangs genannten Portfolios zum letzten RM-Referenzdatum;

xv) ‚ATM' (At the Money): ‚Am Geld' in Bezug auf den relativen Stand des aktuellen oder künftigen Preises des Basiswerts eines Derivats gegenüber dem Ausübungspreis dieses Derivats;

xvi) ‚OTM' (Out of the Money): ‚Aus dem Geld' in Bezug auf den relativen Stand des aktuellen oder künftigen Preises des Basiswerts eines Derivats gegenüber dem Ausübungspreis dieses Derivats;

xvii) ‚ITM' (In the Money): ‚Im Geld' in Bezug auf den relativen Stand des aktuellen oder künftigen Preises des Basiswerts eines Derivats gegenüber dem Ausübungspreis dieses Derivats;

xviii) ‚long': ‚gekauft' und ‚short': ‚verkauft';

xix) ‚CDS': Credit Default Swaps (Kreditausfallswaps);

xx) bei CDS steht ‚Long' für den ‚Kauf einer Absicherung' und ‚Short' für den ‚Verkauf einer Absicherung'.

xxi) ‚Mio.': Millionen;

xxii) ‚OTC': Over the Counter (außerbörslich gehandelt);

xxiii) ‚ASA': alternativer Standardansatz im Sinne von Teil 3 Titel IV Kapitel 1a Abschnitt 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013;

xxiv) ‚SBM': sensitivitätsgestützte Methode im Sinne von Teil 3 Titel IV Kapitel 1a Abschnitt 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013;

xxv) ‚DRC' (Default Risk Requirement): Anforderung für das Ausfallrisiko im Sinne von Teil 3 Titel IV Kapitel 1a Abschnitt 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013;

xxvi) ‚RRAO' (Residual Risk Add-On): Aufschlag für Restrisiken im Sinne von Teil 3 Titel IV Kapitel 1a Abschnitt 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013.

b) Für das Benchmarking gelten folgende Datumsvorgaben:

i) Buchungsdatum ist der 30. Januar 2025;

ii) IMV- (und erstes SBM-)Referenzdatum ist der 6. Februar 2025 (17.30 Uhr MEZ);

iii) IMV- (und erster SBM- und SBM-Validierungs-)Einreichungstermin ist der 28. Februar 2025;

iv) erstes RM-Referenzdatum ist der 2. Juni 2025;

v) letztes RM- (und letztes ASA-)Referenzdatum ist der 13. Juni 2025;

vi) RM- (und letzter ASA-)Einreichungstermin ist der 18. Juli 2025.

c) Sofern in Abschnitt 2 dieses Anhangs nicht ausdrücklich anders festgelegt, werden alle Positionen zu dem unter Buchstabe b Ziffer i dieses Abschnitts genannten Buchungsdatum gebucht. Sobald die Positionen gebucht wurden, altert jedes Portfolio während der Dauer des Benchmarkings und wird unter der Annahme berechnet, dass das Institut während der gesamten Dauer des Benchmarkings nicht in die Verwaltung des Portfolios eingreift. Sofern in den Spezifikationen für das jeweilige Instrument nichts anderes vorgegeben ist, werden die Ausübungspreise für Optionspositionen in Relation zu den am Buchungsdatum festgestellten Schlusskursen des betreffenden Basiswerts ermittelt.

d) Für die Zwecke der ursprünglichen Marktbewertung muss die Bewertung eines jeden Instruments zum IMV-Einreichungstermin bei der zuständigen Behörde des Instituts eingereicht werden. Bis zu diesem Termin muss das Institut zu den Ergebnissen auch Erläuterungen im Sinne von Buchstabe e übermitteln. Die IMV wird nach Möglichkeit in Übereinstimmung mit der Frontoffice-Bewertung des Instituts bereitgestellt. Werden die IMVs nicht vom Frontoffice des Instituts bereitgestellt, muss das Institut in seinen Erläuterungen angeben, aus welcher Quelle die IMV-Daten stammen.

e) Die Erläuterungen, die die Institute zusammen mit der IMV übermitteln, müssen für jedes Instrument Folgendes enthalten:

i) die zur Berechnung der IMV des Instruments verwendeten Risikofaktoren;

ii) das zur Berechnung der IMV des Instruments verwendete Preismodell und eine Beschreibung dieses Preismodells;

iii) die in das VaR-Modell für das Instrument eingehenden Risikofaktoren;

iv) die in das VaR-Modell eingehenden Risikofaktoren, die als Bewertungsfaktoren auch in die IMV des Instruments eingehen;

v) Spezifika des VaR-Modells in Bezug auf das Instrument;

vi) verfügbare Referenzdaten für das Instrument im institutseigenen Format;

vii) die unter den Buchstaben h, i, k, m, n, o, v, w, y, gg und kk dieses Abschnitts genannten Aspekte.

f) Für die Zwecke von Buchstabe e Ziffer v ist alles Folgende anzugeben:

i) Kurzbeschreibung des VaR-Modells;

ii) angewandte Neubewertungsmethoden;

iii) funktionale Form für die Modellierung von Renditen (z. B. absolute, relative, andere Methoden);

iv) qualitative Angaben zu den Zeitreihen, die zur Kalibrierung des VaR-Modells in Bezug auf das Instrument verwendet wurden (z. B. Quelle, Normalisierungsmethodik, verwendete Unterklassen, sonstige Informationen, die aus Sicht der Institute zur Erläuterung der übermittelten Ergebnisse von Belang sind).

g) Die unter Buchstabe d genannten Erläuterungen werden jedes Mal aktualisiert, wenn ein neuer Wert eingereicht wird, um den Veränderungen zwischen den Datenübermittlungen Rechnung zu tragen. Die Erläuterungen müssen einen Abschnitt enthalten, in dem alle Einreichungstermine und die Gründe für Neuübermittlungen aufgeführt sind.

h) Bei der Berechnung der Positionsrisiken werden die Finanzierungskosten nicht berücksichtigt. Gegebenenfalls verwenden die Institute den Tagesgeldsatz in der Währung des Instruments als Abzinsungssatz. Bei den in Abschnitt 2 dieses Anhangs genannten Derivaten wird eine Sicherungsvereinbarung angenommen. Ist dies nicht möglich, müssen in den unter Buchstabe d genannten Erläuterungen Gründe dafür angegeben werden.

i) Das Gegenparteiausfallrisiko und das Risiko einer Anpassung der Kreditbewertung (‚CVA-Risiko') bleiben bei der Bewertung der Risiken der Portfolios unberücksichtigt. Ist dies nicht möglich, müssen in den unter Buchstabe d dieses Abschnitts genannten Erläuterungen Gründe dafür angegeben werden. Die Institute geben an, in welchen Fällen andere Typologien von Bewertungsanpassungen in die IMV eingehen, und führen in den unter Buchstabe d dieses Abschnitts genannten Erläuterungen für jedes Finanzinstrument die Methodik und die Auswirkungen an.

j) Bei Transaktionen, die Kaufpositionen in CDS beinhalten, nehmen die Institute an, dass in Übereinstimmung mit den üblichen Marktstandards und -konventionen die sofortige Zahlung einer Upfront-Provision erfolgt, um die Position einzugehen. Der Fälligkeitstermin muss bei allen CDS den üblichen vierteljährlichen Kündigungsterminen entsprechen.

k) Werden für die erforderlichen Preisberechnungen für CDS-Positionen zusätzliche Spezifikationen benötigt, müssen diese den üblichen Marktstandards und -konventionen entsprechen und in den unter Buchstabe d dieses Abschnitts genannten Erläuterungen ausgeführt werden.

l) Der Fälligkeitstermin muss sicherstellen, dass die Transaktion der nach den üblichen Marktstandards und -konventionen festgelegten Restlaufzeit möglichst nahekommt.

m) Was die Einzelheiten der in Abschnitt 2 dieses Anhangs nicht genannten Instrumente angeht, müssen die Institute in den unter Buchstabe d dieses Abschnitts genannten Erläuterungen die zugrunde gelegten Annahmen, einschließlich der Zinsberechnungsmethode und des gewählten handelbaren und liquiden Instruments, sofern zulässig, samt Ergebnissen angeben.

n) Sind aus Sicht der Institute für die Interpretation der Ergebnisse weitere Annahmen als die in diesem Abschnitt genannten relevant (Zeitpunkt des Geschäftsschlusses, Coupon Rolls, Zuordnung zu Indizes u. a.), so sind diese in den unter Buchstabe d dieses Abschnitts genannten Erläuterungen zu beschreiben.

o) Die unter Buchstabe d dieses Abschnitts genannten Erläuterungen müssen auch Erläuterungen zu Risiken enthalten, die von dem Modell für die in Abschnitt 2 dieses Anhangs genannten Instrumente nicht erfasst werden.

p) Sofern nicht ausdrücklich anders angegeben, sind alle Optionen als außerbörslich gehandelt (‚OTC') zu behandeln.

q) Bei OTC-Optionen sind die üblichen Zeitkonventionen zu befolgen. Die Laufzeit einer ‚n-monatigen' Option beträgt n Monate. Erlöschen Optionen nicht an einem Handelstag, passen die Institute den Verfallstag nach den üblichen Marktstandards und -konventionen werktäglich an.

r) Alle OTC-Optionen werden wie folgt eingestuft:

   i) im Falle von Aktien auf Einzeladressen und Waren als amerikanisch;

   ii) im Falle von Aktienindizes, Devisen und Swaptions als europäisch.

s) Sämtliche OTC-Optionen gelten als ‚ungedeckt', sodass die Prämie wird aus der ursprünglichen Marktbewertung ausgenommen wird.

t) Institute, die für CTPs das APR-Modell verwenden dürfen, müssen Einzelheiten zu ihren wichtigsten Annahmen sowie Marktstandards und -konventionen hinsichtlich der CTP-Instrumente in Abschnitt 2 dieses Anhangs angeben, einschließlich der Sicherungsquoten, die sie berechnet haben, damit die CTP-Instrumente zum Buchungsdatum CS01-neutral sind.

u) Die IMV muss für jedes Instrument in der Währung angegeben werden, die in Abschnitt 2 dieses Anhangs als EBA-Instrument-Währung festgelegt ist.

v) Bei Portfolios aus einem oder mehreren Instrumenten in EBA-Instrumentewährungen, die von der EBA-Portfoliowährung abweichen, wird das Ergebnis zum EZB-Devisenkassakurs vom betreffenden Tag in die gemeldete EBA-Portfoliowährung umgerechnet. Das umgerechnete Ergebnis ist in den unter Buchstabe d dieses Abschnitts genannten Erläuterungen zu erklären.

w) Bei der Buchung von Positionen befolgen die Institute die einschlägigen Marktkonventionen, sofern in diesen Erläuterungen bei der Beschreibung der Instrumente (Abschnitt 2 dieses Anhangs) nichts anderes festgelegt ist.

x) Ist ein Instrument oder der Basiswert eines Derivats von einer Unternehmensmaßnahme (Corporate Action) betroffen, die sich auf das Benchmarking auswirkt (z. B. Kündigungsrecht (call) des Emittenten, Ausfall oder ähnliche Maßnahme), so klammern die Institute dieses Instrument samt aller zugehörigen CDS oder Optionen aus dem Portfolio aus.

y) In Bezug auf eine Indexreihe bezeichnet ‚On-the-run' die liquideste und handelbarste auf dem Markt verfügbare Reihe dieses Index. Die Institute erläutern ihre Entscheidung für eine bestimmte ‚On-the-run'-Reihe samt Ergebnissen in den unter Buchstabe d dieses Abschnitts genannten Erläuterungen.

z) Sofern nicht anders angegeben, wenden die Institute für den Zinssatz die EU-Benchmark-Verordnung an, um die in Abschnitt 2 dieses Anhangs genannten Instrumente zu verbuchen. Die Institute geben den Satz, der außer den in Abschnitt 2 dieses Anhangs genannten Sätzen angewandt wurde, im Rahmen der unter Buchstabe d genannten Erläuterung an.

aa) Die Risikomessgrößen für die in den Abschnitten 3, 4 und 5 genannten Portfolios samt Barwert sind vom ‚ersten RM-Referenzdatum' bis zum ‚letzten RM-Referenzdatum' zu berechnen. Die ASA-Risikomessgrößen nach FRTB (SBM, DRC und RRAO) sind für das ‚letzte RM-Referenzdatum' zu berechnen. Die Institute müssen ihrer zuständigen Behörde die Ergebnisse dieser Berechnungen bis zum ‚RM-Einreichungstermin' übermitteln. IMV und SBM müssen für jedes Instrument angegeben werden. Risikomessgrößen, SBM, DRC, RRAO und Barwert, soweit anwendbar, müssen für jedes Portfolio angegeben werden, sowohl für einzelne als auch für aggregierte Portfolios. SBM, DRC und RRAO sind, soweit anwendbar, mindestens für dieselben Portfolios zu melden, für die Risikomessgrößen gemeldet werden.

bb) Für die in Abschnitt 7 genannten Portfolios melden die Institute die SBM-Ergebnisse und übermitteln sie gemäß den Meldestichtagen für die IMV-Meldung.

cc) Angaben zu Kreditspread-Portfolios sind nur von Instituten zu übermitteln, denen die Modellierung spezifischer Risiken von Schuldtiteln genehmigt wurde. Im Falle von Zins-Portfolios, bei denen das Risiko Teil bestimmter Instrumente ist, sind die einzelnen und die aggregierten Portfolios sowohl von den Instituten zu modellieren, denen die Modellierung des allgemeinen Zinsrisikos gestattet wurde, als auch von den Instituten, denen die Modellierung des allgemeinen und des spezifischen Zinsrisikos genehmigt wurde.

dd) Die Ergebnisse sowohl für die einzelnen als auch für die aggregierten Portfolios sind nur dann zu übermitteln, wenn die Ergebnisse für die darin enthaltenen Instrumente ebenfalls übermittelt werden.

ee) In Abschnitt 2 dieses Anhangs (Instrumente) bezeichnet das ‚Jahr T' ‚2025' und ‚Jahr T + X' ‚2025 + X', wobei X im Sinne von Abschnitt 2 zu verstehen ist.

ff) In Abschnitt 2 dieses Anhangs (Instrumente) haben die Institute den Verfallstag/die Fälligkeit folgendermaßen zu bestimmen:

  i) Ist ein Datum angegeben, wird dieses Datum verwendet.

  ii) Ist kein Datum angegeben, wird, sofern vorhanden, die Marktkonvention angewandt. Besagt z. B. eine Marktkonvention, dass der Verfallstag/Fälligkeitstag der 3. Freitag des Monats ist, dann bedeutet ‚Juni Jahr T' den dritten Freitag des betreffenden Monats im Jahr T.

  iii) ‚Ende' eines Monats bedeutet am letzten Kalendertag des betreffenden Monats.

  iv) Im Falle eines festen Zeitraums nach dem ‚Buchungsdatum' ist, wenn die Zahl der Tage angegeben ist, der letzte Tag des Zeitraums gemeint. Ist der Zeitraum in Wochen, Monaten oder Jahren definiert, so ist es derselbe Tag der/des auf das Buchungsdatum folgenden Woche, Monats oder Jahres, oder wenn der letzte Monat oder das letzte Jahr dieses Zeitraums kürzer ist, der letzte Tag dieses Monats oder Jahres. Ist das ‚Buchungsdatum + Zeitraum X' ein Feiertag, ist der folgende Geschäftstag zu wählen.

  v) Falls nicht anders angegeben, sind folgende Annahmen zu verwenden: Zinsberechnungsmethode: Act/360, Feiertagskalender: Target2.

gg) In Abschnitt 2 dieses Anhangs (Instrumente) gelten, sofern nicht anders angegeben, für alle CDS die folgenden Vorgaben:

  i) Kuponzahlung: vierteljährlich

  ii) Kupon (Basispunkte): 100

  iii) Zinsberechnungsmethode: ACT/360

  iv) ISDA-Definitionen Jahr: 2014

v) Umstrukturierungsklausel: Modified-Modified Restructuring (MMR)

vi) Fälligkeit: Dezember Jahr T+4

vii) Art der Schuld: Vorrangig

viii) Laufzeit: 5 Jahre

ix) Stichtag wie Buchungsdatum

x) Die verwendete Abzinsungskurve und Erlösquote sind in den unter Buchstabe d dieses Anhangs genannten Erläuterungen anzugeben.

hh) Die IMV von Anleiheinstrumenten beinhaltet aufgelaufene Zinsen.

ii) Die Institute müssen den PV-Bewertungszeitpunkt unter Angabe des Zeitpunkts in den unter Buchstabe d dieses Abschnitts genannten Erläuterungen angeben. Nach Möglichkeit soll die PV-Bewertung zum Geschäftsschluss erfolgen.

jj) Die Risikomessgrößen der Portfolios werden in der Währung berechnet, auf die auch das Portfolio lautet, und schließen keinerlei Wechselkursrisiko ein, auch nicht in Bezug auf die Währung der Rechnungslegung der Institute. Das Wechselkursrisiko ist nur dann zu berücksichtigen, wenn es untrennbar mit den Instrumenten verbunden ist. Werden die Ergebnisse sowohl in der Währung der Rechnungslegung als auch in der Portfoliowährung ausgewiesen, so werden für die ASA-Zahlen die in der Währung der Rechnungslegung des Instituts berechneten Ergebnisse zum EZB-Devisenkassakurs vom Tag, an dem die Berechnung angestellt wird, in die EBA-Portfoliowährung umgerechnet. Die Umrechnung in die EBA-Portfoliowährung impliziert keine Veränderung bei den Fremdwährungsrisikofaktoren.

kk) Findet Artikel 325q Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (‚Basiswährungsansatz') Anwendung, so berücksichtigen die Institute bei ihren SBM-Berechnungen und bei der Meldung der SBM-Sensitivitäten die aus der Anwendung des Basiswährungsansatzes resultierenden Wechselkursrisikofaktoren. Die gemeldeten Werte werden nicht in der gewählten Basiswährung ausgedrückt, sondern in der Währung der Rechnungslegung des Instituts, wobei die Umrechnung zum EZB-Devisenkassakurs vom jeweiligen Tag erfolgt.

Abschnitt 2: Instrumente

Die Institute stellen die IMV gemäß den Erläuterungen in Abschnitt 1 dieses Anhangs für folgende Finanzinstrumente bereit, für die sie die Risikomessgrößen und den Barwert der in den Abschnitten 3 und 4 genannten Portfolios zur Verfügung stellen müssen:

AKTIEN

101. Longposition Futures, EURO STOXX 50 Index (Ticker: FESX)

Nominalbetrag: Gegenwert von Indexwert mal 1 000 EUR

Börse: Eurex

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

102. Longposition 10 000 Anteile, BAYER (Ticker: BAYN GR)

Börse: Xetra

EBA-Instrument-Währung: EUR

103. Shortposition Futures, BAYER (Ticker: BAYN GR).

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Börse: Eurex

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

104. Shortposition Futures, STELLANTIS (Ticker: STLA FP)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Börse: Euronext

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

105. Shortposition Futures, ALLIANZ (Ticker: ALV GR)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Börse: Eurex

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

106. Shortposition Futures, BARCLAYS (Ticker: BARC LN)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Börse: Eurex

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: GBP

107. Shortposition Futures, DEUTSCHE BANK (Ticker: DBK GR)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Börse: Eurex

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

108. Shortposition Futures, CRÉDIT AGRICOLE (Ticker: ACA FP)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Börse: Euronext

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

109. Long-Call-Optionen. Basiswert BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (1 Vertrag = 100 Anteile)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

110. Short-Call-Optionen. Basiswert BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (1 Vertrag = 100 Anteile)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Verfallstag: Dezember Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

111. Long-Call-Optionen. Basiswert PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM (1 Vertrag = 100 Anteile)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: USD

112. Long-Put-Optionen. Basiswert PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM (1 Vertrag = 100 Anteile)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: USD

113. Long-Call-Optionen. Basiswert BAYER (Ticker: BAYN GR) 10 % OTM (1 Vertrag = 100 Anteile)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Verfallstag: Dezember Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

114. Short-Call-Optionen. Basiswert BAYER (Ticker: BAYN GR) 10 % OTM (1 Vertrag = 100 Anteile)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

115. Long-Call-Optionen. Basiswert AVIVA (Ticker: AV/LN) 10 % OTM (1 Vertrag = 100 Anteile)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Verfallstag: Dezember Jahr T

EBA-Instrument-Währung: GBP

116. Long-Put-Optionen. Basiswert AVIVA (Ticker: AV/LN) 10 % OTM (1 Vertrag = 100 Anteile)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts

Verfallstag: Dezember Jahr T

EBA-Instrument-Währung: GBP

117. Shortposition Futures, NIKKEI 225 (Ticker NKY)

Nominalbetrag: Gegenwert von Indexwert mal 20 000 JPY

Börse: CME

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: JPY

118. Aktienprodukt, Auto-Callable

Long-Position

Buchung zum ‚Buchungszeitpunkt'

Nominalbetrag (‚Kapitalbetrag'): 1 000 000 EUR

Basiswert: Index EURO STOXX 50 (Ticker: SX5E)

EBA-Instrument-Währung: EUR

Fälligkeit: 5 Jahre

Jährliche Auszahlung und jährliche Beobachtung (‚Buchungsdatum + 1 Jahr', ‚Buchungsdatum + 2 Jahre', ‚Buchungsdatum + 3 Jahre', ‚Buchungsdatum + 4 Jahre', ‚Buchungsdatum + 5 Jahre'). Die Auszahlung erfolgt 10 Tage nach dem Stichtag.

Kupon: 6 %

Autocall-Level (‚ursprünglicher Wert'): Buchungsdatum Tagesschluss + 1 Monat

Barriere Kuponzahlung: 60 % des Autocall-Levels

Schutzbarriere: 55 % des Autocall-Levels

— Nicht garantiertes Kapital, falls der Index unter der Schutzbarriere liegt (der Kapitalrückfluss im fünften Jahr ist anteilig, falls die Schutzbarriere unterschritten wird: liegt beispielsweise der SX5E bei 40 % seines ursprünglichen Levels, ist der Kapitalrückfluss gleich 40 %).

— Falls SX5E ≥ 60 % (Barriere Kupon) des ursprünglichen Werts zum Ende eines Jahres, wird ein Kupon von 6 % ausbezahlt.

— Falls SX5E ≥ 100 % des ursprünglichen Werts zum Ende eines Jahres, erfolgt ein Produkt-Call und die Auszahlung umfasst Kupon und Kapital (100 %).

— Falls SX5E < 60 % (Barriere Kupon) des ursprünglichen Werts zum Ende eines Jahres, wird kein Kupon ausbezahlt.

— Falls SX5E < 55 % (Schutzbarriere) des ursprünglichen Werts zum Ende von Jahr 5, wird das Kapital nur anteilig ausbezahlt. Falls SX5E >= 55 % (Schutzbarriere) des ursprünglichen Werts zum Ende von Jahr 5, wird das Kapital vollständig ausbezahlt.

119. Long-Call-Optionen. Basiswert EURO STOXX 50 Index (Ticker: SX5E), ATM

Nominalbetrag: Gegenwert von Indexwert mal 1 000 EUR

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

120. Long-Call-Optionen. Basiswert EURO STOXX 600 Index (Ticker: SXXP), ATM

Nominalbetrag: Gegenwert von Indexwert mal 10 000 EUR

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

121. Long-Call-Optionen. Basiswert VIX (CBOE), ATM

Nominalbetrag: Gegenwert von Indexwert mal 100 000 USD

Verfallstag: Juni Jahr T

EBA-Instrument-Währung: USD

IR

201. Fünf-Jahres-IRS EUR – Erhalte Festsatz und zahle variablen Satz

Festsatzseite: erhalte jährlich

Variabler Zinssatz: 6-Monats-EURIBOR, zahle halbjährlich Zinsberechnung: ACT/360

Nominalbetrag: 10 000 000 EUR

Roll-Konvention und Kalender: Standard

Stichtag wie Buchungsdatum (d. h. Börsenschlusskurse vom Buchungsdatum zu verwenden)

Fälligkeit: September Jahr T+4.

EBA-Instrument-Währung: EUR

202. Zwei-Jahres-EUR-Swaption auf 5-Jahres-IRS EUR — Zahle Festsatz und erhalte variablen Satz.

Nominalbetrag: 10 000 000 EUR.

Das Institut ist der Verkäufer der Option auf den Swap. Die Gegenpartei des Instituts kauft das Recht, einen Swap mit dem Institut abzuschließen; übt die Gegenpartei ihr Recht aus, erhält sie den festen Satz, während das Institut den variablen Satz erhält.

Swaption mit einer Laufzeit von zwei Jahren (Buchungsdatum + 2 Jahre) auf IRS, definiert wie folgt: Festsatzseite – zahle jährlich; Variabler Zinssatz: 6-Monats-EURIBOR, erhalte halbjährlich; Nominalbetrag: 10 000 000 EUR Roll-Konvention und Kalender: Standard; Stichtag des zugrunde liegenden Swaps: Buchungsdatum + 2 Jahre

Fälligkeit des zugrunde liegenden Swaps: Buchungsdatum + 7 Jahre

Prämienzahlung zum Buchungsdatum (Buchungsdatum). Cash-settled

Ausübungspreis basiert auf dem ATM-Kurs des bei diesem Instrument definierten Forward Swaps.

EBA-Instrument-Währung: EUR

203. Fünf-Jahres-IRS USD. Erhalte festen Satz und zahle variablen Satz

Festsatz: erhalte jährlich

Variabler Zinssatz: 3-Monats-USD-SOFR, zahle vierteljährlich

Nominalbetrag: 1 000 000 USD

Roll-Konvention und Kalender: Standard

Stichtag wie Buchungsdatum (d. h. Börsenschlusskurse vom Buchungsdatum zu verwenden)

Fälligkeitstermin: September Jahr T+4.

EBA-Instrument-Währung: USD

204. 2-Jahres-IRS GBP. Erhalte festen Satz und zahle variablen Satz

Festsatz: erhalte jährlich

Variabler Zinssatz: SONIA-(Tagesgeld-)Satz, aufgezinst und vierteljährlich gezahlt Zinsberechnung: ACT/365

Nominalbetrag: 10 000 000 GBP

Roll-Konvention und Kalender: Standard

Stichtag wie Buchungsdatum (d. h. Börsenschlusskurse vom Buchungsdatum zu verwenden)

Fälligkeit: Buchungsdatum + 2 Jahre

EBA-Instrument-Währung GBP

205. 10-jährige UBS Floating Rate Note mit Collar

Nominal-(Kapital-)betrag: 1 000 000 USD

Die variabel verzinslichen Schuldverschreibungen sind vorrangige unbesicherte Verbindlichkeiten der UBS AG (‚UBS').

EBA-Instrument-Währung USD

— Die Schuldverschreibungen sind zu einem Jahressatz verzinslich, der dem 3-Monats-USD-SOFR zuzüglich 1,5 % pro Jahr (‚variabler Zinssatz') entspricht, wobei eine Obergrenze von 7,5 % pro Jahr (‚Zinsobergrenze') und eine Untergrenze von 2,5 % pro Jahr (‚Zinsuntergrenze') gilt.

— Jegliche Zahlungen im Zusammenhang mit den Schuldverschreibungen, einschließlich Zinsen und Kapitalbetrag bei Fälligkeit, setzen voraus, dass die UBS AG kreditwürdig ist. Die Institute werden aufgefordert, eine geeignete Abzinsungskurve zu verwenden, die in den Erläuterungen zu erklären ist.

— Ertrag: Für die Schuldverschreibungen werden vierteljährlich Zinsen zu einem Zinssatz gezahlt, der unter folgenden Voraussetzungen dem variablen Zinssatz entspricht: i.) liegt der variable Zinssatz zum Zeitpunkt der Kuponbestimmung unter der Zinsuntergrenze, so entspricht der für die betreffende Zinsperiode anzuwendende Zinssatz der Zinsuntergrenze; ii.) liegt der variable Zinssatz zum Zeitpunkt der Kuponbestimmung über der Zinsobergrenze, so entspricht der für die betreffende Zinsperiode anwendbare Zinssatz der Zinsobergrenze.

Zinszahlungsbetrag	Der für eine Zinsperiode auf Schuldverschreibungen zu zahlende Zinsbetrag entspricht dem Produkt aus: dem Kapitalbetrag der Schuldverschreibungen, b) dem für diese Zinsperiode geltenden Zinssatz und c) einer Bruchzahl, deren Zähler die Anzahl der Tage der Zinsperiode (berechnet auf der Grundlage eines 360-Tage-Jahres mit zwölf 30-Tage-Monaten) und deren Nenner 360 ist.
Handels- und Abwicklungsdatum	‚Buchungsdatum'
Zinszahlungsdaten	Vierteljährlich, zum Buchungsdatum + 3 Monate, Buchungsdatum + 6 Monate, Buchungsdatum + 9 Monate und Buchungsdatum + 1 Jahr, beginnend am Buchungsdatum + 3 Monate während der Laufzeit der Schuldverschreibungen (vorbehaltlich der darin beschriebenen Anpassungen)
Fälligkeitstermin	Buchungsdatum + 10 Jahre
Währung	USD
Zinsberechnungsbasis	30/360
Geschäftstagekonvention	Following unadjusted
Kuponbestimmung Datum	Für jede Zinsperiode am vorletzten Londoner Bankarbeitstag unmittelbar vor dem jeweiligen Zinsstichtag. Ein ‚Londoner Bankarbeitstag' ist ein Tag, an dem die Geschäftsbanken für allgemeine Geschäfte (einschließlich für Devisengeschäfte und Deviseneinlagen) in London geöffnet sind und an dem Geschäfte in US-Dollar auf dem Londoner Interbankmarkt getätigt werden können.

206. Longposition GERMANY GOVT (Inflation) 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030583)

Fälligkeit: 15. April 2033

EBA-Instrument-Währung: EUR

207. Shortposition GERMANY GOVT 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030708)

Fälligkeit: 15. August 2030

EBA-Instrument-Währung: EUR

208. Longposition ITALY GOVT (Inflation) 1 000 000 EUR (ISIN IT0005138828)

Fälligkeit: 15. September 2032

EBA-Instrument-Währung: EUR

209. Longposition ITALY GOVT 1 000 000 EUR (ISIN IT0005340929)

Fälligkeit: 1. Dezember 2028

EBA-Instrument-Währung: EUR

210. Longposition SPAIN GOVT 1 000 000 EUR (ISIN ES00000127A2)

Fälligkeit: 30. Juli 2030

EBA-Instrument-Währung: EUR

211. Shortposition FRANCE GOVT 1 000 000 EUR (ISIN FR0012993103)

Fälligkeit: 25. Mai 2031
EBA-Instrument-Währung: EUR

212. Shortposition GERMANY GOVT 1 000 000 EUR (ISIN DE0001135176)

Fälligkeit: 4. Januar 2031
EBA-Instrument-Währung: EUR

213. Longposition UNITED KINGDOM GOVT 1 000 000 GBP (ISIN GB0004893086)

Fälligkeit: 7. Juni 2032
EBA-Instrument-Währung: GBP

214. Longposition PORTUGAL GOVT 1 000 000 EUR (ISIN PTOTEXOE0024)

Fälligkeit: 15. Juni 2029
EBA-Instrument-Währung: EUR

215. Shortposition UNITED STATES GOVT 1 000 000 USD (ISIN US91282CAV37)

Fälligkeit: 15. November 2030
EBA-Instrument-Währung USD

216. Longposition BRAZIL GOVT (callable) 1 000 000 USD (ISIN US105756BZ27)

Fälligkeit: 13. Januar 2028
EBA-Instrument-Währung: USD

217. Longposition MEXICO GOVT (callable) 1 000 000 USD (ISIN US91087BAT70)

Fälligkeit: 19. Mai 2033
EBA-Instrument-Währung USD

218. 10-Jahres-IRS EURO — erhalte variablen Satz und zahle Festsatz

Festsatzseite: zahle jährlich
Variabler Zinssatz: 3-Monats-Euribor, erhalte vierteljährlich Zinsberechnung: ACT/360
Nominalbetrag: 10 000 000 EUR
Roll-Konvention und Kalender: Standard
Stichtag wie Buchungsdatum (d. h. Börsenschlusskurse vom Buchungsdatum zu verwenden)
Fälligkeit: Buchungsdatum + 10 Jahre
EBA-Instrument-Währung: EUR

219. 5-Jahres-IRS EURO – erhalte variablen Satz und zahle Festsatz

Festsatzseite: zahle jährlich
Variabler Zinssatz: 6-Monats-Euribor, erhalte alle 6 Monate Zinsberechnung: ACT/360
Nominalbetrag: 10 000 000 EUR
Roll-Konvention und Kalender: Standard
Stichtag wie Buchungsdatum (d. h. Börsenschlusskurse vom Buchungsdatum zu verwenden)
Fälligkeit: Buchungsdatum + 5 Jahre
EBA-Instrument-Währung: EUR

220. ‚Mark-to-Market'-bewerteter (5 Jahre) Währungsswap EUR/USD Erhalte USD und zahle EUR.

EUR: 3-Monats-ESTER, zahle vierteljährlich, aufgezinst mit einer Zahlungsverzögerung von 2 Tagen Zinsberechnung: ACT/360

USD: 3-Monats-SOFR, erhalte vierteljährlich, aufgezinst mit einer Zahlungsverzögerung von 2 Tagen Zinsberechnung: ACT/360

Seite 1 – USD: Nominalbetrag 10 000 000 EUR, Gegenwert bereinigt auf vierteljährlicher Basis

Seite 2 – EUR: Nominalbetrag 10 000 000 EUR,

Roll-Konvention und Kalender: Standard

Stichtag wie Buchungsdatum + 6 Monate

Fälligkeit: Buchungsdatum + 5,5 Jahre

EBA-Instrument-Währung: EUR

Siehe auch Abschnitt 6 dieses Anhangs ‚Instrumente – zusätzliche Spezifikationen'

221. 10-Jahres-IRS EURO – erhalte ESTER-Satz und zahle EURIBOR

ESTER-Seite: erhalte jährlich Zinsberechnung: ACT/360

EURIBOR-Seite: 3-Monats-Euribor + Basis, zahle vierteljährlich Zinsberechnung: ACT/360

Nominalbetrag: 10 000 000 EUR

Roll-Konvention und Kalender: Standard

Stichtag wie Buchungsdatum (d. h. Börsenschlusskurse vom Buchungsdatum zu verwenden)

Fälligkeit: September Jahr T + 9 Jahre

EBA-Instrument-Währung: EUR

222. Longposition ITALY GOVT (Inflation) 1 000 000 EUR (ISIN IT0005387052)

Fälligkeit: 15. Mai 2030

EBA-Instrument-Währung: EUR

223. Fünf-Jahres-Zero-Coupon-Inflation-Swap EUR – erhalte inflationsindexierte Rendite und zahle Festsatz (r)

Inflationsindex: VPI (HVPIxT)

Festsatzseite (zahle Festsatz): $[(1 + r)^5\text{-}1]$

Erhalte inflationsindexierte Rendite: $\left[\left(\frac{VPI\ am\ Fälligkeitstermin}{VPI\ am\ Starttag}\right)\text{-}1\right]$

Nominalbetrag: 10 000 000 EUR

Basisfixingtermin: Juni Jahr T-1

Endgültiges Fixing: August Jahr T+4

Fälligkeit: September Jahr T+4

EBA-Instrument-Währung: EUR

224. Zwei-Jahres-EUR-Swaption auf 5-Jahres-IRS EUR — Zahle Festsatz und erhalte variablen Satz

Nominalbetrag: 10 000 000 EUR.

Das Institut ist der Verkäufer der Option auf den Swap. Die Gegenpartei des Instituts kauft das Recht, einen Swap mit dem Institut abzuschließen; übt die Gegenpartei ihr Recht aus, erhält sie den variablen Satz, während das Institut den festen Satz erhält.

Swaption mit einer Laufzeit von zwei Jahren (Buchungsdatum + 2 Jahre) auf IRS, definiert wie folgt: Festsatzseite: erhalte jährlich Variabler Zinssatz: 6-Monats-Euribor, zahle alle 6 Monate Nominalbetrag: 10 000 000 EUR Roll-Konvention und Kalender: Standard; Stichtag des zugrunde liegenden Swaps: Buchungsdatum + 2 Jahre

Fälligkeit des zugrunde liegenden Swaps: Buchungsdatum + 7 Jahre

Prämienzahlung zum Buchungsdatum (Buchungsdatum). Cash-settled

Ausübungspreis basiert auf dem ATM-Kurs des bei diesem Instrument definierten Forward Swaps +100 Basispunkte

EBA-Instrument-Währung: EUR

FX

301. 6-monatiger USD/EUR Forward-Vertrag. Cash-settled. USD Long – EUR Short; Nominalbetrag 10 000 000 USD; Ausübungspreis des Forwards: entspricht 100 % des entsprechenden EZB- Referenzkassakurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

EBA-Instrument-Währung: EUR

302. 6-monatiger EUR/GBP Forward-Vertrag. Cash-settled. EUR Long – GBP Short; Nominalbetrag 10 000 000 GBP; Ausübungspreis des Forwards: entspricht 100 % des entsprechenden EZB- Referenzkassakurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

EBA-Instrument-Währung: EUR

303. Longposition 10 000 000 USD Cash.

Cash-Position. Es ist von einem inhärenten Wechselkursrisiko im Sinne von Abschnitt kk auszugehen.

EBA-Instrument-Währung: EUR

304. Long-EUR/USD-Call-Option (EUR Long, USD Short). Cash-settled. Nominalbetrag: 10 000 000 EUR. Gegenwert auf Basis des EUR/USD-EZB-Referenzkassakurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum.

Ausübungspreis: 110 % des EUR/USD-EZB-Referenzkurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

Verfallstag: Buchungsdatum + 1 Jahr

EBA-Instrument-Währung: EUR

305. Long-EUR/USD-Call-Option (EUR Long, USD Short). Cash-settled. Nominalbetrag: 10 000 000 EUR. Gegenwert auf Basis des EUR/USD-EZB-Referenzkassakurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum.

Ausübungspreis: 90 % des EUR/USD-EZB-Referenzkurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

Verfallstag: Buchungsdatum + 1 Jahr

EBA-Instrument-Währung: EUR

306. Short-EUR/USD-Call-Option (EUR Short, USD Long). Cash-settled. Nominalbetrag: 10 000 000 EUR. Gegenwert auf Basis des EUR/USD-EZB-Referenzkassakurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum.

Ausübungspreis: 100 % des EUR/USD-EZB-Referenzkurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

Verfallstag: Buchungsdatum + 1 Jahr

EBA-Instrument-Währung: EUR

307. Short-EUR/GBP-Call-Option (EUR Short, GBP Long). Cash-settled. Nominalbetrag: 10 000 000 EUR. Gegenwert auf Basis des EUR/GBP-EZB-Referenzkassakurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

Ausübungspreis: 110 % des EUR/GBP-EZB-Referenzkurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

Verfallstag: Buchungsdatum + 1 Jahr

EBA-Instrument-Währung: EUR

308. Long-EUR/JPY-Put-Option (EUR Short, JPY Long). Cash-settled. Nominalbetrag: 10 000 000 EUR. Gegenwert auf Basis des EUR/JPY-EZB-Referenzkassakurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum.

Ausübungspreis: 110 % des EUR/JPY-EZB-Referenzkurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

Verfallstag: Buchungsdatum + 1 Jahr

EBA-Instrument-Währung: EUR

309. Short-EUR/AUD-Put-Option (EUR Long, AUD Short). Cash-settled. Nominalbetrag: 10 000 000 EUR. Gegenwert auf Basis des EUR/AUD-EZB-Referenzkassakurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

Ausübungspreis: 110 % des EUR/AUD-EZB-Referenzkurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

Verfallstag: Buchungsdatum + 1 Jahr

EBA-Instrument-Währung: EUR

310. 6-Monats-EUR/DKK-Forward-Vertrag (EUR Long, DKK Short). Cash-settled; Nominalbetrag 10 000 000 EUR; EUR/DKK-EZB-Referenzkassakurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum zur Ermittlung des Terminkurses

EBA-Instrument-Währung: EUR

311. 6-Monats-EUR/BRL Nicht lieferbarer Forward-Vertrag (EUR Long, BRL Short); Nominalbetrag 10 000 000 EUR; EUR/BRL-EZB-Referenzkassakurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum zur Ermittlung des Terminkurses

EBA-Instrument-Währung: EUR

WARENPOSITIONEN

401. Long 6-Monats-London Gold Forward,
3 500 Feinunzen (Gold Long, USD Short). Cash-settled. Ausübungspreis: 6-Monats-Forward-Kurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum

EBA-Instrument-Währung: USD

402. Short 12-Monats-London Gold Forward, 3 500 Feinunzen (Gold Short, USD Long). Cash-settled. Ausübungspreis: 12-Monats-Forward-Kurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum

EBA-Instrument-Währung: USD

403. Long-Call-Option 30 000 Barrel Rohöl Brent (WTI Long, USD Short). Cash-settled. Ausübungspreis: 12-Monats-Forward-Kurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum Verfallstag: Buchungsdatum + 6 Monate

EBA-Instrument-Währung USD

404. Short-Put-Option 30 000 Barrel Rohöl Brent (WTI Long, USD Short). Cash-settled. Ausübungspreis: 12-Monats-Forward-Kurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum Verfallstag: Buchungsdatum + 6 Monate

EBA-Instrument-Währung USD

405. Long-Call-Option 5 000 Feinunzen London Gold (Gold Long, USD Short). Cash-settled. Ausübungspreis: 18-Monats-Forward-Kurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum Verfallstag: Buchungsdatum + 18 Monate

EBA-Instrument-Währung: USD

KREDITSPREAD

501. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf PORTUGAL

Umstrukturierungsklausel: VOLL

EBA-Instrument-Währung: USD

502. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf ITALIEN

Umstrukturierungsklausel: VOLL
EBA-Instrument-Währung: USD

503. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf SPANIEN

Umstrukturierungsklausel: VOLL
EBA-Instrument-Währung: USD

504. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf MEXIKO

Umstrukturierungsklausel: VOLL
EBA-Instrument-Währung: USD

505. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf BRASILIEN

Umstrukturierungsklausel: VOLL
EBA-Instrument-Währung: USD

506. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf UK

Umstrukturierungsklausel: VOLL
EBA-Instrument-Währung: USD

507. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) 1 000 000 EUR, CDS auf Telefonica (Ticker TEF SM)

EBA-Instrument-Währung: EUR

508. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 EUR, CDS auf Telefonica (Ticker TEF SM)

Fälligkeit: Dezember Jahr T+2
EBA-Instrument-Währung: EUR

509. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) 1 000 000 EUR, CDS auf Aviva (Ticker AV LN)

ISDA-Definitionen Jahr 2003
EBA-Instrument-Währung: EUR

510. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 EUR, CDS auf Aviva (Ticker AV LN)

ISDA-Definitionen Jahr 2003
Fälligkeit: Dezember Jahr T+2
EBA-Instrument-Währung: EUR

511. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) 1 000 000 EUR, CDS auf Vodafone (Ticker VOD LN)

EBA-Instrument-Währung: EUR

512. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) 1 000 000 EUR, CDS auf ENI SpA (Ticker EMI IM)

EBA-Instrument-Währung: EUR

513. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf Eli Lilly (Ticker LLY US)

Umstrukturierungsklausel: Keine Umstrukturierung (XR14)
EBA-Instrument-Währung: USD

514. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) 1 000 000 EUR, CDS auf Unilever (Ticker UNA NA)

EBA-Instrument-Währung: EUR

515. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 EUR, CDS auf Total SA (Ticker FP FP)

EBA-Instrument-Währung: EUR

516. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 EUR, CDS auf Volkswagen Group (Ticker VOW GR)

EBA-Instrument-Währung: EUR

517. Longposition TURKEY GOVT 1 000 000 USD (ISIN US900123CT57)

Fälligkeit: 26. April 2029
EBA-Instrument-Währung: USD

518. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf TÜRKEI Stichtag wie Buchungsdatum

Umstrukturierungsklausel: VOLL
EBA-Instrument-Währung: USD

519. Longposition 1 000 000 EUR Schuldverschreibungen Telefonica (ISIN XS1681521081)

Fälligkeit: 12. Januar 2028
EBA-Instrument-Währung: EUR

520. Longposition 1 000 000 EUR Schuldverschreibungen Volkswagen Group (ISIN XS2234567233)

Fälligkeit: 22. September 2028
EBA-Instrument-Währung: EUR

521. Shortposition 1 000 000 EUR Schuldverschreibungen Volkswagen Group (ISIN XS1167667283)

Fälligkeit: 16. Januar 2030
EBA-Instrument-Währung: EUR

522. Longposition 1 000 000 EUR Schuldverschreibungen Total SA (ISIN XS1856281834)

Fälligkeit: 11. Juli 2033
EBA-Instrument-Währung: EUR

523. Longposition AUSTRIA GOVT 1 000 000 EUR (ISIN AT0000A04967)

Fälligkeit: 15. März 2037
EBA-Instrument-Währung: EUR

524. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf ÖSTERREICH

Fälligkeit: Juni Jahr T+15
EBA-Instrument-Währung: USD

525. Longposition NETHERLANDS GOVT 1 000 000 EUR (ISIN NL0013552060)

Fälligkeit: 15. Januar 2040
EBA-Instrument-Währung: EUR

526. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf NIEDERLANDE

Fälligkeit: Juni Jahr T+20
EBA-Instrument-Währung: USD

527. Longposition BELGIUM GOVT 1 000 000 EUR (ISIN BE0000348574)

Fälligkeit: 22. Juni 2050
EBA-Instrument-Währung: EUR

528. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) 1 000 000 USD, CDS auf BELGIEN

Fälligkeit: Juni Jahr T+30
EBA-Instrument-Währung: USD

529. Longposition (Kauf einer Absicherung) 10 000 000 EUR CDS auf iTraxx Europe Index, On-the-run-Reihe

Fälligkeit: Juni Jahr T+4
EBA-Instrument-Währung: EUR

530. Short-Put-Option. 10 000 000 EUR. Basiswert iTraxx Europe Index, On-the-run-Reihe (selbes Instrument wie 529).

Ausübungspreis: ATM
Verfallstag: Buchungsdatum + 6 Monate
EBA-Instrument-Währung: EUR

531. Longposition 1 000 000 EUR AXA SA (callable) (ISIN XS1799611642)

Fälligkeit: 28. Mai 2049
EBA-Instrument-Währung: EUR

532. Longposition 1 000 000 USD AT&T Bond (callable) (ISIN US00206RFW79)

Fälligkeit: 15. August 2037
EBA-Instrument-Währung: USD

533. Longposition 1 000 000 EUR BAYER AG (callable) (ISIN XS2199266268)

Fälligkeit: 6. Januar 2030
EBA-Instrument-Währung: EUR

534. Longposition 1 000 000 EUR ORANGE SA Bond (callable) (ISIN FR0013323870)

Fälligkeit: 20. März 2028
EBA-Instrument-Währung: EUR

ZENTRALE TESTPLATTFORM (CTP)

601. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) in iTraxx Europe Index, On-the-run-Reihe

Attachment-Point: 3 %
Detachment-Point: 6 %
Nominalbetrag: 5 000 000 EUR
Fälligkeit: 5 Jahre
EBA-Instrument-Währung: EUR

602. Longposition (Kauf einer Absicherung) 5 000 000 EUR CDS auf iTraxx Europe Index, jüngste On-the-run-Reihe

Fälligkeit: Juni Jahr T+4
EBA-Instrument-Währung: EUR
Nominal ber. zur Vollabsicherung von CS01 aus 601 ohne Neuabsicherungsbedarf

603. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) in iTraxx Europe Index, On-the-run-Reihe

Attachment-Point: 3 %
Detachment-Point: 6 %
Nominalbetrag: 5 000 000 EUR

Fälligkeit: 5 Jahre

EBA-Instrument-Währung: EUR

604. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) 5 000 000 EUR CDS auf iTraxx Europe Index, jüngste On-the-run-Reihe

Fälligkeit: Juni Jahr T+4

EBA-Instrument-Währung: EUR

Nominal ber. zur Vollabsicherung von CS01 aus 603 ohne Neuabsicherungsbedarf

605. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) in iTraxx Europe Index, On-the-run-Reihe

Attachment-Point: 12 %

Detachment-Point: 100 %

Nominalbetrag: 5 000 000 EUR

Fälligkeit: 5 Jahre

EBA-Instrument-Währung: EUR

606. Longposition (Kauf einer Absicherung) 5 000 000 EUR CDS auf iTraxx Europe Index, jüngste On-the-run-Reihe

Fälligkeit: Juni Jahr T+4

EBA-Instrument-Währung: EUR

Nominal ber. zur Vollabsicherung von CS01 aus 605 ohne Neuabsicherungsbedarf

607. Longposition (d. h. Kauf einer Absicherung) in iTraxx Europe Index, On-the-run-Reihe

Attachment-Point: 12 %

Detachment-Point: 100 %

Nominalbetrag: 5 000 000 EUR

Fälligkeit: 5 Jahre

EBA-Instrument-Währung: EUR

608. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) 5 000 000 EUR CDS auf iTraxx Europe Index, jüngste On-the-run-Reihe

Fälligkeit: Juni Jahr T+4

EBA-Instrument-Währung: EUR

Nominal ber. zur Vollabsicherung von CS01 aus 607 ohne Neuabsicherungsbedarf

609. Shortposition (d. h. Verkauf einer Absicherung) in iTraxx Europe Index, On-the-run-Reihe

Attachment-Point: 3 %

Detachment-Point: 6 %

Nominalbetrag: 5 000 000 EUR

Fälligkeit: 5 Jahre

EBA-Instrument-Währung: EUR

Erlösquote: 40 % fest

610. Longposition (Kauf einer Absicherung) 5 000 000 EUR CDS auf iTraxx Europe Index, jüngste On-the-run-Reihe

Fälligkeit: Juni Jahr T+4

EBA-Instrument-Währung: EUR

Nominal ber. zur Vollabsicherung von CS01 aus 609 ohne Neuabsicherungsbedarf

Abschnitt 3: Einzelne Portfolios – Einzelnes Instrument

Die Institute stellen die erforderlichen Risikomessgrößen und den Barwert der folgenden Einzelportfolios bereit:

Portfolio	*Kombination aus Instrumenten* Die erste Zahl steht für das Instrument (laut Abschnitt 2 dieses Anhangs). Die zweite Zahl gibt die Menge des jeweiligen Instruments bzw. die Anzahl der Kontrakte an.	EBA-Portfolio-Währung	Erforderliche Risikomessgrößen
1001	101 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1002	102– 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1003	103 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1004	104 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1005	105– 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1006	106 – 1 Instrument	GBP	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1007	107 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1008	108 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1009	109 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1010	110 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1011	111 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1012	112 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1013	113 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1014	114 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1015	115 – 1 Instrument	GBP	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1016	116 – 1 Instrument	GBP	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1017	117 – 1 Instrument	JPY	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1018	118 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO

1019	119 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1020	120 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1021	121 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2001	201 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2002	202 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2003	203 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2004	204 – 1 Instrument	GBP	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2005	205 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2006	206 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2007	207 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2008	208– 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2009	209 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2010	210 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2011	211 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2012	212 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2013	213 – 1 Instrument	GBP	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2014	214 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2015	215 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2016	216 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2017	217 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2018	218 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2019	219 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2020	220 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2021	221 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2022	222 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO

2023	223 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2024	224 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3001	301 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3002	302 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3003	303 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3004	304 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3005	305 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3006	306 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3007	307 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3008	308 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3009	309 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3010	310 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3011	311 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
4001	401 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
4002	402 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
4003	403 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
4004	404 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
4005	405 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
5001	501 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5002	502 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5003	503 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5004	504 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5005	505 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5006	506 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5007	507 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO

5008	508 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5009	509 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5010	510 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5011	511 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5012	512 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5013	513 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5014	514 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5015	515 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5016	516 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5017	517 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5018	518 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5019	519 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5020	520 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5021	521 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5022	522 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5023	523 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5024	524 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5025	525 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5026	526 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5027	527 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5028	528 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5029	529 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5030	530 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5031	531 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5032	532 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO

5033	533 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5034	534 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
6001	601 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6002	602 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6003	603 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6004	604 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6005	605 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6006	606 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6007	607 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6008	608 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6009	609 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6010	610 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO

Abschnitt 4: Einzelne Portfolios – Mehrere Instrumente

Die Institute stellen die erforderlichen Risikomessgrößen und den Barwert der folgenden Einzelportfolios bereit:

Portfolio	*Kombination aus Instrumenten* Die erste Zahl steht für das Instrument (laut Abschnitt 2 dieses Anhangs). Die zweite Zahl gibt die Menge des jeweiligen Instruments bzw. die Anzahl der Kontrakte an.	EBA-Portfolio-Währung	Erforderliche Risikomessgrößen
1101	103 – 1 Instrument 104 – 1 Instrument 105 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1102	113 – 1 Instrument 110 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1103	115 – 1 Instrument 116 – 1 Instrument	GBP	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1104	109 – 1 Instrument 110 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO

1105	111 – 1 Instrument 112 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1106	102 – 1 Instrument 114 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1107	106 – 1 Instrument 107 – 1 Instrument 108 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1108	101 – 1 Instrument 103 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1109	101 – 1 Instrument 103 – 1 Instrument 104 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
1110	102– 1 Instrument 104 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2201	206 – 1 Instrument 207 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2202	206 – 1 Instrument 207 – 1 Instrument 208 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2203	206 – 1 Instrument 207 – 1 Instrument 208 – 1 Instrument 209 – 1 Instrument 210 – 1 Instrument 211 – 1 Instrument 212 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2204	201 – 1 Instrument 218 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2205	201 – 1 Instrument 219 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2206	218 – 1 Instrument 219 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2207	201 – 1 Instrument 202 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
2208	215 – 1 Instrument 216 – 1 Instrument 217 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2209	203 – 1 Instrument 215 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO

2210	208 – 1 Instrument 209 – 1 Instrument 210 – 1 Instrument 214 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2211	209 – 1 Instrument 219 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
2212	201 – 1 Instrument 223 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3301	301 – 1 Instrument 302 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3302	303 – 1 Instrument 304 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3303	304 – 1 Instrument 305 – 1 Instrument 306 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
3304	307 – 1 Instrument 308 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
4401	401 – 1 Instrument 402 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
4402	403 – 1 Instrument 404 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
4403	401 – 1 Instrument 404 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
5501	501 – 1 Instrument 502 – 1 Instrument 503 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5502	504 – 1 Instrument 505 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5503	507 – 1 Instrument 508 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5504	503 – 1 Instrument 504 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5505	509 – 1 Instrument 510 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5506	511 – 1 Instrument 512 – 1 Instrument 514 – 1 Instrument 515 – 1 Instrument 516 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO

5507	517 – 1 Instrument 518 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5508	519 – 1 Instrument 520 – 1 Instrument 522 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5509	520 – 1 Instrument 521 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5510	519 – 1 Instrument 508 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5511	515 – 1 Instrument 522 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5512	520 – 1 Instrument 521 – 1 Instrument 516 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5513	506 – 1 Instrument 503 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5514	502 – 1 Instrument 209 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5515	504 – 1 Instrument 217 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5516	505 – 1 Instrument 216 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5517	504 – 1 Instrument 217 – 1 Instrument 505 – 1 Instrument 216 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5518	502 – 1 Instrument 209 – 1 Instrument 219 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5519	523 – 1 Instrument 525 – 1 Instrument 527 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5520	524 – 1 Instrument 526 – 1 Instrument 528 – 1 Instrument	USD	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
5521	523 – 1 Instrument 524 – 1 Instrument 525 – 1 Instrument 526 – 1 Instrument 527 – 1 Instrument 528 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO

5522	529 – 1 Instrument 530 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
6601	601 – 1 Instrument 602 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6602	603 – 1 Instrument 604 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6603	605 – 1 Instrument 606 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6604	607 – 1 Instrument 608 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO
6605	609 – 1 Instrument 610 – 1 Instrument	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO

Abschnitt 5: Aggregierte Portfolios

Die Institute stellen die erforderlichen Risikomessgrößen und den Barwert der folgenden aggregierten Finanzportfolios bereit:

Aggreg. Portfolio	Beschreibung	*Kombination einzelner Portfolios* (einzelne Portfolios laut Nummernangabe in Abschnitt 3 und 4 dieses Anhangs)	EBA-Portfoli-o-Währung	Erforderliche Risikomessgrößen
10000	Gesamtportfolio Nicht-CTP	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
11000	AKTIEN kumulativ	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
12000	IR kumulativ	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
13000	FX kumulativ	3301, 3303, 3304	EUR	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
14000	Warenposition kumulativ	4401, 4402	USD	VaR, sVaR, SBM, DRC, RRAO
15000	Kreditspread kumulativ	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR, sVaR, IRC, SBM, DRC, RRAO
16000	CTP kumulativ in EUR	6601, 6602	EUR	VaR, sVaR, APR, SBM, DRC, RRAO

Abschnitt 6: Instrumente – zusätzliche Spezifikationen

Die Institute wenden auf die in Abschnitt 2 dieses Anhangs genannten Finanzinstrumente folgende zusätzliche Spezifikationen an:

Instrument	220
Beschreibung:	‚Mark-to-Market'-bewerteter (5 Jahre) Währungsswap EUR/USD Erhalte USD und zahle EUR Nominalbetrag: 10 000 000 EUR, USD (10 000 000 EUR * FX USD/EUR)
Zahle:	Variable Seite 2
Erhalte:	Variable Seite 1
Nominalbetrag-Umtausch und -Reset:	Am Stichtag und Fälligkeitstermin. Außerdem erfolgt zu jedem Kupon-Zahlungstermin eine zusätzliche Zahlung, die der Anpassung an den USD-Nominalbetrag auf variabler Seite 2 entspricht. Der USD-Nominalbetrag wird 2 Geschäftstage vor jedem Zahlungstermin zum Kassakurs so angepasst, dass er 10 000 000 EUR entspricht.
Barsaldo	Inkludiert
Variable Seite 1	
Nominalbetrag:	10 000 000 EUR Gegenwert am Stichtag zum Kassakurs in USD umgerechnet, Gegenwert bereinigt auf vierteljährlicher Basis
Stichtag:	Buchungsdatum + 6 Monate
Fälligkeitstermin:	Buchungsdatum + 5,5 Jahre
Zahlungstermin-Generierung:	Forward ab Stichtag
Kuponzahlung:	Vierteljährlich
Kupon:	3-Monats-SOFR + 0 Basispunkte
Kupon-Reset:	Vierteljährlich
Kupon-Fixing-Konvention:	Über den 3-Monats-Zeitraum täglich aufgezinst
Kupon-Zinseszinsberechnung:	Einfache Zinsen
Zinsberechnungsmethode:	ACT/360
Geschäftstag Zahlungstermin:	LON, NYC, TARGET
Geschäftstagekonvention Zahlungstermin:	Modified Following
Geschäftstag Nominalbetrag-Reset:	LON, NYC, TARGET
Geschäftstagekonvention Nominalbetrag-Reset:	Zurück
Geschäftstag Kupon-Reset:	LON, NYC, TARGET
Geschäftstagekonvention Kupon-Reset:	Zurück

Variable Seite 2	
Nominalbetrag:	10 000 000 EUR
Stichtag:	Buchungsdatum + 6 Monate
Fälligkeitstermin:	Buchungsdatum + 5,5 Jahre
Zahlungstermin-Generierung:	Forward ab Stichtag
Kuponzahlung:	Vierteljährlich
Kupon:	3-Monats-ESTER + 0 Basispunkte
Kupon-Reset:	Vierteljährlich
Kupon-Fixing-Konvention:	Über den 3-Monats-Zeitraum täglich aufgezinst
Kupon-Zinseszinsberechnung:	Einfache Zinsen
Zinsberechnungsmethode:	ACT/360
Geschäftstag Zahlungstermin:	LON, NYC, TARGET
Geschäftstag Zahlungstermin:	Modified Following
Geschäftstag Nominalbetrag-Reset:	LON, NYC, TARGET
Geschäftstagekonvention Nominalbetrag-Reset:	Zurück
Geschäftstag Kupon-Reset:	LON, NYC, TARGET
Geschäftstagekonvention Kupon-Reset:	Zurück

Abschnitt 7: SBM-Validierungsportfolios

a) Im Rahmen der IMV-Meldung übermitteln die Institute die SBM-Risikomessgröße der in Anhang X (SBM-Validierungsportfolios) definierten Portfolios und übermitteln sie gemäß den Meldestichtagen für die IMV-Meldung.

b) Für die Übermittlung der Ergebnisse für die SBM-Validierungsportfolios gilt Folgendes:

i. Die Institute übermitteln nur den Meldebogen C120.02 und beschränken die Angaben in diesem Meldebogen auf die Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung (d. h. Spalte 0060 des Meldebogens C120.02 ist nicht auszufüllen, und die Meldebögen C106.00 und C106.01 werden für die SBM-Validierungsportfolios nicht übermittelt).

ii. Die Institute legen die Annahme zugrunde, dass die durch die in Anhang X genannten Instrumente definierten Risikosensitivitäten und Krümmungsrisikopositionen in der Währung der Rechnungslegung des Instituts ausgedrückt werden und dass die Angaben in dem Format bereitgestellt werden, das in den Erläuterungen zu den Meldebögen C106.01/C120.01 und in der zugehörigen Erläuterungstabelle in Anhang VI (Meldebogenspezifische Erläuterungen) spezifiziert sind.“

ANHANG III

„ANHANG VI

ERGEBNISSE DER AUFSICHTLICHEN REFERENZPORTFOLIOS

MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN

C 106.00 —
Ursprüngliche Marktbewertung und Gründe für die Nichteinbeziehung 57

C 106.01 —
SBM. Risikosensitivitäten nach Instrument 57

C 107.01 – VaR und sVaR Nicht-CTP. Nähere Angaben 61

C 107.02 – VaR, sVaR und PV – Nicht-CTP. Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung 63

C 108.00 – Gewinn- und Verlust-Zeitreihen 64

C 109.01 – IRC. Nähere Angaben zum Modell 65

C 109.02 – IRC. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios 65

C 109.03 – IRC. Betrag nach Portfolio/Datum 66

C 110.01 – CT. Nähere Angaben zum Modell 67

C 110.02 – CT. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios 68

C 110.03 – CT. APR nach Portfolio/Datum 69

C 120.01 – SBM. RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO 69

C 120.02 – SBM. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO 72

C 120.04 – DRC. MARKTWERTE UND JTD-BRUTTOBETRÄGE NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO 74

C 120.05 —
DRC. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO 80

C 120.06 – ASA. OFR 82

MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN

C 106.00 — Ursprüngliche Marktbewertung und Gründe für die Nichteinbeziehung

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V.
0020	Modellierung des Instruments für VaR und sVaR (JA/NEIN)		Bitte entweder JA oder NEIN angeben.
0030	Modellierung des Instruments für IRC (JA/NEIN)		Bitte entweder JA oder NEIN angeben.
0040	Modellierung des Instruments für Korrelationshandel (JA/NEIN)		Bitte entweder JA oder NEIN angeben.
0050	Grund für die Nichteinbeziehung	Artikel 3 Absatz 2	Auszuwählen ist eine der folgenden Möglichkeiten: a) Modell von der Regulierungsbehörde nicht genehmigt. b) Instrument oder Basiswert intern nicht genehmigt. c) Basiswert oder Modellierungsmerkmal intern nicht vorgesehen. d) Anderer Grund für die Nichteinbeziehung. Bitte in Spalte 0060 erläutern.
0060	Freitextfeld		In dieser Spalte kann das Institut zusätzliche Angaben machen.
0070	Ursprüngliche Marktbewertung (‚IMV')		Nach der Mark-to-Market-Methode ermittelter Wert jedes einzelnen Instruments um 17:30 Uhr MEZ am Stichtag (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b). Möchte das Institut für ein bestimmtes Portfolio keine IMV bereitstellen, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).

C 106.01 — SBM. Risikosensitivitäten nach Instrument

Hier melden die Institute die Sensitivitäten gegenüber den Risikofaktoren, denen das Instrument ausgesetzt ist. Dabei ist ein Risikofaktor/eine Sensitivität pro Zeile anzugeben. Die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition des betreffenden Risikofaktors (CVRk+) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk-) im Sinne von Artikel 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist in eigenen Zeilen zu melden. Alle Werte sind auf das ‚IMV- (und das erste SBM-)Referenzdatum' im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b Ziffer ii dieser Verordnung zu beziehen. Die Institute dürfen jede Kombination aus Instrumentennummer, Risikokennung (Spalte 0010), Unterklasse (Spalte 0020) und Zusätzlicher Kennung (Spalte 0030) nur einmal melden.

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Risikofaktor-Kennung	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben ist die einschlägige Risikofaktor-Kennung aus der Tabelle am Ende dieses Anhangs.
0020	Unterklasse	Artikel 325d Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Unterklasse auszuweisen, je nachdem, welcher Risikoklasse die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung entspricht: — Allgemeines Zinsrisiko – anzugeben ist die Währung des Risikofaktors maßgebliche risikofreie Zinssätze, Inflationsrisiko oder Basis-Währungsrisiko (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR‘). — Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen – anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ah Absatz 1 Tabelle 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. — Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR Nicht-ACTP) – anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325am Absatz 1 Tabelle 7 der genannten Verordnung. — Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR ACTP) – anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ak Tabelle 6 der genannten Verordnung. — Aktienkursrisiko – anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ap Absatz 1 Tabelle 8 der genannten Verordnung. — Warenpositionsrisiko – anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325as Tabelle 9 der genannten Verordnung. — Fremdwährungsrisiko und Komponenten Delta oder Krümmung – anzugeben ist die Währung (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚USD‘). — Fremdwährungsrisiko und Komponente Vega – anzugeben ist das Währungspaar (Währungscodes nach ISO 4217, z. B. ‚EUR_USD‘).
0030	Zusätzliche Kennung 1	Artikel 325l bis 325q und 325ai der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Um den Risikofaktor innerhalb der Unterklasse genauer zu kennzeichnen, werden die nachstehend ausgeführten Angaben gemeldet. Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse — Allgemeines Zinsrisiko und Delta-Komponente, so ist die Bezeichnung der risikofreien Kurve oder eine andere entsprechende eindeutige Kennung anzugeben; — Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen oder der Risikoklasse Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR ACTP), so ist der Name des Emittenten oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben, der bzw. die für zwei gemeldete Sensitivitäten gegenüber zwei Risikofaktoren, für

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			die nach Artikel 325ai Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ein Korrelationsparameter $\rho_{kl}^{(name)}$ gleich 1 gilt, identisch ist. — Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR Nicht-ACTP), so ist die Bezeichnung der Tranche oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben; — Aktienkursrisiko, so ist die Aktienemittenten-Adresse oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben; — Warenpositionsrisiko, so ist die Bezeichnung der Ware oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben. Trifft keiner dieser Fälle zu, melden die Institute einen expliziten Wert (NULL) als nicht zutreffend.
0050	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325g, 325r, 325s, 325 t und 325ax der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Risikosensitivitäten (Delta/Vega-Sensitivitäten und Krümmungsrisikopositionen) sind für alle in den Spalten 0010 bis 0030 genannten relevanten Risikofaktoren auf der Ebene des einzelnen Instruments anzugeben. Für die Angaben dieser Werte ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts zu verwenden. Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung — der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Netto-Sensitivität gegenüber dem Risikofaktor (S_k) im Sinne von Artikel 325r der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben. Haben die Institute von ihrer zuständigen Behörde die Erlaubnis zur Verwendung alternativer Begriffsbestimmungen der Delta-Risikosensitivitäten nach Artikel 325t Absatz 5 der genannten Verordnung erhalten, so beziehen sie sich bei ihrer Meldung auf diese alternativen Begriffsbestimmungen. — der Vega-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Vega-Risikosensitivität einer Option gegenüber einem gegebenen Risikofaktor (S_k) im Sinne von Artikel 325s der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben. Haben die Institute von ihrer zuständigen Behörde die Erlaubnis für alternative Berechnungen der Vega-Risikosensitivitäten nach Artikel 325t Absatz 6 der genannten Verordnung erhalten, so beziehen sie sich bei ihrer Meldung auf diese alternativen Berechnungen. Unabhängig davon, ob das Institut die Begriffsbestimmung nach Artikel 325s oder eine alternative Berechnung nach Artikel 325t Absatz 6 der genannten Verordnung verwendet, ist die Sensitivität nach Gewichtung mit der entsprechenden impliziten Volatilität anzugeben. — der Krümmungsrisikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVR_k^+) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVR_k^-) im Sinne von Artikel 325g der genannten Verordnung anzugeben. Die gemeldete Zahl ist mit einer Genauigkeit von mindestens zwei Dezimalstellen anzugeben. Nullwerte sind nur dann anzugeben, wenn die Berechnung tatsächlich null ergibt.
0060	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR‘).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0070	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung des EBA-Instruments)	Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung und Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325g, 325r und 325s der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0050 anzugeben, allerdings umgerechnet zum EZB-Kassakurs für die Währung des Instruments im Sinne von Anhang V Abschnitt 2 dieser Verordnung.
0080	Bewertungsmodell	Artikel 325t der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier gibt das Institut an, aus welchem Bewertungsmodell die Sensitivitäten abgeleitet werden. Auszuwählen ist eine der folgenden Möglichkeiten: a) ‚Bewertungsmodelle des Instituts, die als Grundlage für die Meldung von Gewinnen und Verlusten an das höhere Management dienen' (im Sinne von Artikel 325t Absatz 1 Unterabsatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013); b) ‚Auf internen Modellen des Instituts basierender Ansatz' (im Sinne von Artikel 325 t Absatz 1 Unterabsatz 2 der genannten Verordnung).
0090	Definition der Sensitivitäten	Artikel 325r, 325s und 325t der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Das Institut gibt an, welche Definition der Sensitivitäten bei der Berechnung der Eigenmittelanforderungen zugrunde gelegt wird. Auszuwählen ist eine der folgenden Möglichkeiten: a) ‚Definition der Sensitivitäten nach den Artikeln 325r und 325s der Verordnung (EU) Nr. 575/2013'; b) ‚Definition der Sensitivitäten nach Artikel 325t Absätze 5 und 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013'. Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktorkennung der Krümmungsrisikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist der unter Buchstabe b genannte Wert auszuweisen, falls eine der bei der Berechnung der gemeldeten Krümmungsrisikoposition verwendeten Sensitivitäten auf einer Sensitivitätsdefinition nach Artikel 325t Absätze 5 und 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 basiert; andernfalls ist der unter Buchstabe a genannte Wert auszuweisen.
0100	Freitextfeld		In dieser Spalte können zusätzliche Angaben zum Bewertungsmodell und zur Definition der Sensitivitäten gemacht werden.
0110	Zusätzliche Kennung 2	Artikel 325p Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse Warenpositionsrisiko und der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so sind die rechtlichen Bestimmungen in Bezug auf den Lieferort oder eine andere entsprechende eindeutige Kennung anzugeben. Trifft keiner dieser Fälle zu, melden die Institute einen expliziten Wert (NULL) als nicht zutreffend.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0120	Bonitätskategorie	Artikel 325m Absatz 1 und Artikel 325ah Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen und der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: a) ‚Bonitätsstufe 1‘; b) ‚Bonitätsstufe 2‘; c) ‚Bonitätsstufe 3‘; d) ‚Bonitätsstufe 4‘; e) ‚Bonitätsstufe 5‘; f) ‚Bonitätsstufe 6‘; g) ‚Keine Bonitätsstufe (unbeurteilt)‘. Trifft keiner dieser Fälle zu, melden die Institute einen expliziten Wert (NULL) als nicht zutreffend.

C 107.01 – VaR und sVaR Nicht-CTP. Nähere Angaben

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010-0060	VaR		
0010	Methodik		In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) Historische Simulation; b) Monte-Carlo-Simulation; c) Parametrisch; d) Kombination/sonstige Methodik (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.
0020	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen	Artikel 365 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) 1 Tag aufskaliert auf 10 Tage; b) 10 Tage ohne Überlappungsperioden; c) 10 Tage, sonstige Methodik. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0030	Länge des Beobachtungs-zeit-raums	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) bis zu 1 Jahr; b) mehr als 1 Jahr, bis zu 2 Jahre; c) mehr als 2 Jahr, bis zu 3 Jahre; d) mehr als 3 Jahre. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0040	Datengewichtung	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) Ungewichtet (VaR-Datengewichtung); b) Gewichtet (VaR-Datengewichtung); c) Jeweils höherer Wert von ‚Ungewichtet' unter a und ‚Gewichtet' unter b (VaR-Datengewichtung). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0050	Backtesting-Zuschlags-faktor	Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Der Backtesting-Zuschlagsfaktor ist der Zuschlagsfaktor zwischen 0 und 1 aus Artikel 366 Absatz 2 Tabelle 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0060	Aufsichtlicher VaR-Zuschlagsfaktor	Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (‚mindestens 3')	Der aufsichtliche VaR-Zuschlagsfaktor ist der von der zuständigen Behörde vorgegebene Zuschlagsfaktor auf den VaR-Multiplikationsfaktor (mindestens 3) nach Maßgabe von Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Der aufsichtliche VaR-Zuschlagsfaktor entspricht der Summe aus dem Backtesting-Zuschlagsfaktor und, falls anwendbar, dem qualitativen Zuschlagsfaktor über 3 hinaus. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0070-0100	sVaR (d. h. VaR unter Stressbedingungen)		
0070	Methodik		In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) Historische Simulation; b) Monte-Carlo-Simulation; c) Parametrisch; d) Kombination/sonstige Methodik (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.
0080	Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen	Artikel 365 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) 1 Tag aufskaliert auf 10 Tage; b) 10 Tage ohne Überlappungsperioden; c) 10 Tage, sonstige Methodik. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0090	Aufsichtlicher sVaR-Zuschlagsfaktor	Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Der aufsichtliche Zuschlagsfaktor ist der von der zuständigen Behörde vorgegebene Zuschlagsfaktor auf den sVaR-Multiplikationsfaktor (mindestens 3) nach Maßgabe von Artikel 366 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Der aufsichtliche Zuschlagsfaktor entspricht der Summe aus 3, dem Backtesting-Zuschlagsfaktor und dem qualitativen Zuschlagsfaktor (falls anwendbar).

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0100	sVaR-Zeitraum	Artikel 365 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	In Spalte 0010 ist eine der folgenden Antworten einzutragen: a) tägliche Berechnung von sVaR, kalibriert auf einen ununterbrochenen 12-Monats-Zeitraum, beginnend mit dem in Spalte 0020 angegebenen Datum; b) wöchentliche Berechnung von sVaR, kalibriert auf einen ununterbrochenen 12-Monats-Zeitraum, beginnend mit dem in Spalte 0020 angegebenen Datum; c) tägliche Berechnung von SVaR, kalibriert auf verschiedene ununterbrochene 12-Monats-Zeiträume im Rahmen der in C107.02 Spalte 0010 angegebenen VaR-Meldestichtage, beginnend mit den in Spalte 0020 angegebenen Daten; d) wöchentliche Berechnung von SVaR, kalibriert auf verschiedene ununterbrochene 12-Monats-Zeiträume im Rahmen der in C107.02 Spalte 0010 angegebenen VaR-Meldestichtage, beginnend mit den in Spalte 0020 angegebenen Daten; e) Maximum der täglichen Berechnung von SVaR, kalibriert auf mehr als einen durchgehenden 12-Monats-Zeitraum; f) Maximum für die wöchentliche Berechnung des Risikopotenzials unter Stressbedingungen, kalibriert auf mehr als einen ununterbrochenen Zeitraum von 12 Monaten; g) Sonstige SVaR-Kalibrierung (bitte spezifizieren). Falls in Spalte 0010 Option a oder b ausgewählt wird, ist in Spalte 0020 das Startdatum im Format ‚TT/MM/JJJJ' anzugeben. Wird in Spalte 0010 die Option c oder d ausgewählt, sind die Startdaten für jede sVaR-Berechnung im Format ‚TT/MM/JJJJ' anzugeben. Wird in Spalte 0010 Option e, f oder g ausgewählt, so ist in Spalte 0020 auch anzugeben, welcher 12-Monats-Zeitraum für jede sVaR-Berechnung verwendet wird.

C 107.02 – VaR, sVaR und PV – Nicht-CTP. Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Portfolionummer aus Anhang V.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Datum		Die Ergebnisse für VaR, sVaR und Barwert (present value – PV) sind für alle 10 Geschäftstage zwischen dem ‚ersten RM-Referenzdatum' und dem ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum' (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ' zu befolgen.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0020	VaR	Artikel 365 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Aufsichtlicher 10-Tages-VaR-Wert für jedes Portfolio, ohne Anwendung des aufsichtlichen Multiplikationsfaktors von ‚mindestens 3'. Für jedes in Spalte 0010 angegebene Datum ist ein Wert auszuweisen. Berechnet das Institut keinen VaR-Wert für das in Spalte 0010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).
0030	sVaR	Artikel 365 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Aufsichtlicher 10-Tages-sVaR-Wert für jedes Portfolio, ohne Anwendung des aufsichtlichen Multiplikationsfaktors von ‚mindestens 3'. Für jedes in Spalte 0010 angegebene Datum ist ein Wert auszuweisen. Berechnet das Institut keinen sVaR-Wert für das in Spalte 0010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).
0040	PV		Angabe des Barwerts (PV) für jedes Portfolio. Für jedes in Spalte 0010 angegebene Datum ist ein Wert auszuweisen. Berechnet das Institut keinen PV für das in Spalte 0010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).

C 108.00 – Gewinn- und Verlust-Zeitreihen

Meldebogen C 108.00 (‚Gewinn- und Verlust-Zeitreihen') ist nur von Instituten auszufüllen, die VaR mittels historischer Simulation berechnen.

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Portfolionummer aus Anhang V.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Datum	Artikel 365 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	An jedem Geschäftstag gemäß dem im Sitzland des Instituts gültigen Kalenderjahr geben die Institute die für die VaR-Berechnung in Spalte 0010 von Meldebogen C 107.02 verwendeten GuV-Reihen mit mindestens 250 Beobachtungswerten ab dem letzten RM- (und dem letzten SBM-)Referenzdatum (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b Ziffer v) zurückreichend an.
0020	Tägliche GuV		Institute, die VaR mittels historischer Simulation berechnen, tragen die vollständigen vom Institut verwendeten historischen Datenreihen mit mindestens ein Jahr umfassenden Datenreihen und mit der anhand historisch simulierter täglicher Risikofaktorveränderungen am Portfolio vorgenommenen Bewertungsänderung (d. h. tägliche GuV) ein (d. h. tägliche GuV-Reihen, die zur Ableitung des aufsichtlichen 1-Tages-VaR verwendet werden).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			Fällt ein Tag im Sitzland des Instituts auf einen gesetzlichen Feiertag, ist das Feld frei zu lassen (d. h. eine GuV von null ist nur dann einzutragen, wenn der hypothetische Wert des Portfolios an einem bestimmten Geschäftstag tatsächlich unverändert ist).

C 109.01 – IRC. Nähere Angaben zum Modell

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Anzahl der Modellierungsfaktoren		EBA/GL/2012/3 Angabe der Anzahl der Modellierungsfaktoren auf der Ebene des IRC-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) 1 Modellierungsfaktor; b) 2 Modellierungsfaktoren; c) Mehr als 2 Modellierungsfaktoren. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0020	Herkunft der LGDs		EBA/GL/2012/3 Angabe der Herkunft der LGDs auf der Ebene des IRC-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Marktkonvention; b) LGD aus IRB; c) Sonstige Herkunft der LGD (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option c ausgewählt, sind dazu in dieser Spalte nähere Angaben zu machen.

C 109.02 – IRC. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Portfolionummer aus Anhang V dieser Verordnung nur für Portfolios, für die IRC-Berechnungen verlangt werden.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Liquiditätshorizont	Artikel 374 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Angabe des auf Portfolioebene angewandten Liquiditätshorizonts. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Bis zu 3 Monate; b) Mehr als 3 bis zu 6 Monate; c) Mehr als 6 bis zu 9 Monate; d) Mehr als 9 bis zu 12 Monate.
0020	Herkunft der PDs		EBA/GL/2012/3 Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten PDs. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Ratingagenturen; b) IRB; c) Marktimplizierte PDs; d) Sonstige Herkunft der PDs (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind hier in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.
0030	Herkunft der Übergangsmatrizen		EBA/GL/2012/3 Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten Übergangsmatrizen. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Ratingagenturen; b) IRB; c) Marktimplizierte Übergangsmatrizen; d) Sonstige Herkunft der Übergangsmatrizen (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind hier in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.

C 109.03 – IRC. Betrag nach Portfolio/Datum

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Portfolionummer aus Anhang V dieser Verordnung nur für Portfolios, für die IRC-Berechnungen verlangt werden.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Datum		IRC ist für alle 10 Geschäftstage zwischen dem ‚ersten RM-Referenzdatum' und dem ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum' (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ' zu befolgen.
0020	IRC	Artikel 372 bis 376 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	EBA/GL/2012/3 Angabe des aufsichtlichen IRC-Werts für jedes Portfolio. Für jedes in Spalte 0010 angegebene Datum ist ein Wert auszuweisen. Berechnet das Institut keine IRC für das in Spalte 0010 angegebene Datum, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Ergebnis der Berechnung tatsächlich gleich null ist).

C 110.01 – CT. Nähere Angaben zum Modell

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Anzahl der Modellierungsfaktoren	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Anzahl der Modellierungsfaktoren auf der Ebene des Korrelationshandels-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) 1 Modellierungsfaktor; b) 2 Modellierungsfaktoren; c) Mehr als 2 Modellierungsfaktoren. In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden.
0020	Herkunft der LGDs	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Herkunft der LGDs auf der Ebene des Korrelationshandels-Gesamtmodells. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Marktkonvention; b) LGD aus IRB; c) Sonstige Herkunft der LGD (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option c ausgewählt, sind dazu in dieser Spalte nähere Angaben zu machen.

C 110.02 – CT. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Portfolionummer aus Anhang V dieser Verordnung nur für Portfolios, für die APR-Berechnungen verlangt werden.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Liquiditätshorizont	Artikel 377 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe des auf Portfolioebene angewandten Liquiditätshorizonts. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Bis zu 3 Monate; b) Mehr als 3 bis zu 6 Monate; c) Mehr als 6 bis zu 9 Monate; d) Mehr als 9 bis zu 12 Monate.
0020	Herkunft der PDs	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten PDs. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Ratingagenturen; b) IRB; c) Marktimplizierte PDs; d) Sonstige Herkunft der PDs (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.
0030	Herkunft der Übergangsmatrizen	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Herkunft der auf Portfolioebene verwendeten Übergangsmatrizen. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Ratingagenturen; b) IRB; c) Marktimplizierte Übergangsmatrizen; d) Sonstige Herkunft der Übergangsmatrizen (bitte angeben). In Spalte 0020 können nähere Angaben zur Antwort in Spalte 0010 eingetragen werden. Wurde in Spalte 0010 Option d ausgewählt, sind in Spalte 0020 nähere Angaben dazu zu machen.

C 110.03 – CT. APR nach Portfolio/Datum

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Portfolionummer aus Anhang V dieser Verordnung nur für Portfolios, für die APR-Berechnungen verlangt werden.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Datum	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	APR (‚All-Price-Risk') ist für alle 10 Geschäftstage zwischen dem ‚ersten RM-Referenzdatum' und dem ‚letzten RM- (und letzten ASA-) Referenzdatum' (laut Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b) anzugeben. Bei Datenangaben ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ' zu befolgen.
0060	APR	Artikel 377 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben sind die Ergebnisse der Anwendung des aufsichtlichen Korrelationshandelsmodells auf jedes Portfolio. Für jedes in Spalte 0010 angegebene Datum ist ein Wert auszuweisen. Verwendet das Institut für das in Spalte 0010 angegebene Datum kein Korrelationshandelsmodell, ist das Feld frei zu lassen (d. h. Nullwerte sind nur dann einzutragen, wenn das Berechnungsergebnis tatsächlich gleich null ist).

C 120.01 – SBM. RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO

Hier melden die Institute — Instrument für Instrument — die Sensitivitäten gegenüber den Risikofaktoren, denen das Instrument ausgesetzt ist. Dabei ist ein Risikofaktor/eine Sensitivität pro Zeile anzugeben. Die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition des betreffenden Risikofaktors (CVRk+) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk-) im Sinne von Artikel 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist in eigenen Zeilen zu melden. Alle Werte sind auf das ‚letzte RM- (und das letzte ASA-)Referenzdatum' (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b Ziffer v dieser Verordnung) zu beziehen. Die Institute dürfen jede Kombination aus Portfolio, Instrumentennummer (Spalte 0010), Risikokennung (Spalte 0020), Unterklasse (Spalte 0030) und Zusätzlicher Kennung (Spalte 0040) nur einmal melden.

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Nummer des Portfolios aus Anhang V.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0020	Risikofaktor-Kennung	Artikel 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben ist die einschlägige Risikofaktor-Kennung aus der Tabelle am Ende dieses Anhangs.
0030	Unterklasse	Artikel 325d Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Unterklasse auszuweisen, je nachdem, welcher Risikoklasse die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktor-Kennung entspricht: — Allgemeines Zinsrisiko. Anzugeben ist die Währung des Risikofaktors maßgebliche risikofreie Zinssätze, Inflationsrisiko oder Basis-Währungsrisiko (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR'). — Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen. Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ah Absatz 1 Tabelle 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. — Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR Nicht-ACTP). Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325am Absatz 1 Tabelle 7 der genannten Verordnung. — Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR ACTP). Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ak Tabelle 6 der genannten Verordnung. — Aktienkursrisiko. Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325ap Absatz 1 Tabelle 8 der genannten Verordnung. — Warenpositionsrisiko. Anzugeben ist die Unterklassennummer nach Artikel 325as Tabelle 9 der genannten Verordnung. — Fremdwährungsrisiko und Komponenten Delta oder Krümmung. Anzugeben ist die Währung (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚USD'). — Fremdwährungsrisiko und Komponente Vega. Anzugeben ist das Währungspaar (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR_USD').
0040	Zusätzliche Kennung 1	Artikel 325l bis 325q und 325ai der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Um den Risikofaktor innerhalb der Unterklasse genauer zu kennzeichnen, werden die nachstehend ausgeführten Angaben gemeldet. Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse — Allgemeines Zinsrisiko und Delta-Komponente, so ist die Bezeichnung der risikofreien Kurve oder eine andere entsprechende eindeutige Kennung anzugeben; — Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen oder der Risikoklasse Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR ACTP), so ist der Name des Emittenten oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben, die für beide gemeldeten Sensitivitäten gegenüber zwei Risikofaktoren, für die gemäß Artikel 325ai Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ein Korrelationsparameter $\rho_{kl}^{(name)}$ gleich 1 gilt, identisch ist. — Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR Nicht-ACTP), so ist die Bezeichnung der Tranche oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben; — Aktienkursrisiko, so ist die Aktienemittenten-Adresse oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben;

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			— Warenpositionsrisiko, so ist die Bezeichnung der Ware oder eine andere eindeutige Kennung anzugeben. Trifft keiner dieser Fälle zu, melden die Institute einen expliziten Wert (NULL) als nicht zutreffend.
0060	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungs-legung)	Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325g, 325r, 325s, 325 t und 325ax der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Risikosensitivitäten (Delta/Vega-Sensitivitäten und Krümmungsrisikopositionen) sind für alle in den Spalten 0020 bis 0040 genannten relevanten Risikofaktoren auf der Ebene des einzelnen Instruments anzugeben. Für die Angaben dieser Werte ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts zu verwenden. Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktor-Kennung — der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Netto-Sensitivität gegenüber dem Risikofaktor (S_k) im Sinne von Artikel 325r der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben. Haben die Institute von ihrer zuständigen Behörde die Erlaubnis zur Verwendung alternativer Berechnungen der Delta-Risikosensitivitäten nach Artikel 325 t Absatz 5 der genannten Verordnung erhalten, so beziehen sie sich bei ihrer Meldung auf diese alternativen Begriffsbestimmungen. — der Vega-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Vega-Risikosensitivität einer Option gegenüber einem gegebenen Risikofaktor (S_k) im Sinne von Artikel 325s der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben. Haben die Institute von ihrer zuständigen Behörde die Erlaubnis für alternative Berechnungen der Vega-Risikosensitivitäten nach Artikel 325t Absatz 6 der genannten Verordnung erhalten, so beziehen sie sich bei ihrer Meldung auf diese alternativen Berechnungen. Unabhängig davon, ob das Institut die Berechnung nach Artikel 325s oder eine alternative Kalkulation nach Artikel 325 t Absatz 6 der genannten Verordnung verwendet, ist die Sensitivität nach Gewichtung mit der entsprechenden impliziten Volatilität anzugeben. — der Krümmungsrisikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist die Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVR_k^+) bzw. die Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVR_k^-) im Sinne von Artikel 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anzugeben. Die gemeldete Zahl ist mit einer Genauigkeit von mindestens zwei Dezimalstellen anzugeben. Nullwerte sind nur dann anzugeben, wenn die Berechnung tatsächlich null ergibt.
0070	Währung der Rechnungs-legung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR').'
0080	Risikosensitivität (Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung)	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung Artikel 325d Absatz 2 sowie Artikel 325g, 325r, 325s, 325 t und 325ax der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0060 anzugeben, allerdings umgerechnet zum EZB-Kassakurs für die Währung des Portfolios im Sinne von Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0090	Risikogewicht	Teil 3 Titel IV Kapitel 1a Abschnitt 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Anzugeben ist das entsprechende Risikogewicht für den Risikofaktor aus Spalte 0020 bis 0040. Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikofaktorkennung der Krümmungsrisikokomponente, ist das Risikogewicht anzugeben, das zur Ermittlung der anwendbaren relativen Verschiebung angewandt wurde. Die gemeldete Zahl ist mit einer Genauigkeit von mindestens vier Dezimalstellen anzugeben.
0110	Zusätzliche Kennung 2	Artikel 325p Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse Warenpositionsrisiko und der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so sind die rechtlichen Bestimmungen in Bezug auf den Lieferort oder eine andere entsprechende eindeutige Kennung anzugeben. Trifft keiner dieser Fälle zu, melden die Institute einen expliziten Wert (NULL) als nicht zutreffend.
0120	Bonitätskategorie	Artikel 325m Absatz 1 und Artikel 325ah Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0010 angegebene Risikofaktor-Kennung der Risikoklasse Kreditspreadrisiko bei Nicht-Verbriefungspositionen und der Delta-Risikokomponente der sensitivitätsgestützten Methode, so ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: a) ‚Bonitätsstufe 1‘; b) ‚Bonitätsstufe 2‘; c) ‚Bonitätsstufe 3‘; d) ‚Bonitätsstufe 4‘; e) ‚Bonitätsstufe 5‘; f) ‚Bonitätsstufe 6‘; g) ‚Keine Bonitätsstufe (unbeurteilt)‘. Trifft keiner dieser Fälle zu, melden die Institute einen expliziten Wert (NULL) als nicht zutreffend.

C 120.02 – SBM. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Nummer des Portfolios aus Anhang V.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Risikoklasse	Artikel 325d Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Risikoklasse. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) ‚Allgemeines Zinsrisiko (GIRR)'; b) ‚Kreditspreadrisiko. CSR bei Nicht-Verbriefungspositionen' (Kreditspreadrisiko (CSR) bei Nicht-Verbriefungspositionen); c) ‚Kreditspreadrisiko. CSR bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen' (CSR außerhalb des alternativen Korrelationshandelsportfolios)); d) ‚Kreditspreadrisiko. CSR bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen' (CSR des alternativen Korrelationshandelsportfolios); e) ‚Aktienkursrisiko'; f) ‚Warenpositionsrisiko'; g) ‚Fremdwährungsrisiko'.
0020	Komponente	Artikel 325e Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe der Komponente der sensitivitätsgestützten Methode. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) ‚Delta-Risiko'; b) ‚Vega-Risiko'; c) ‚Krümmungsrisiko'.
0030	Korrelations-szenario	Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Angabe des Korrelationsszenarios. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) Szenario ‚mittlere Korrelation'; b) Szenario ‚hohe Korrelation'; c) Szenario ‚niedrige Korrelation'.
0040	Eigenmittel-anforderungen (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte für die Eigenmittelanforderungen sind für jedes Portfolio für alle relevanten Kombinationen aus Risikoklasse, Komponente und Korrelationsszenario zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum' (gemäß Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben. Die Werte sind in der Währung der Rechnungslegung des Instituts und mit einer Genauigkeit von mindestens zwei Dezimalstellen anzugeben.
0050	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217).
0060	Eigenmittel-anforderungen (Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung)	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung und Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0040 anzugeben, allerdings umgerechnet zum EZB-Kassakurs für die Währung des Portfolios im Sinne von Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung.
0070	Positionen ohne Optionalität, die Eigenmittel-anforderungen in Bezug auf das Krümmungsrisiko unterliegen	Artikel 325e Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die Komponente in Spalte 0020 dem Krümmungsrisiko, ist Folgendes anzugeben: a) Wendet das Institut zur Berechnung des in den Spalten 0040 und 0060 ausgewiesenen Ergebnisses den Ansatz nach Artikel 325e Absatz 3 Unterabsatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 an, ist ‚JA' anzugeben. b) Andernfalls ist ‚NEIN' anzugeben. ‚NEIN' ist auch dann anzugeben, wenn keine dieser Möglichkeiten zutrifft.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0080	Basiswährungs-ansatz für Delta-Faktor- und Krümmungsrisiko-faktoren des Fremdwährungs-risikos	Artikel 325q Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die Risikoklasse in Spalte 0010 dem Fremdwährungsrisiko und die Komponente in Spalte 0020 dem Delta-Faktor- oder Krümmungsrisiko, ist Folgendes anzugeben: a) Wendet das Institut zur Berechnung des in den Spalten 0040 und 0060 ausgewiesenen Ergebnisses den Ansatz nach Artikel 325q Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 an, ist ‚JA' anzugeben. b) Andernfalls ist ‚NEIN' anzugeben. ‚NEIN' ist auch dann anzugeben, wenn keine dieser Möglichkeiten zutrifft.
0090	Division der Krümmungsrisiko-komponenten für das Fremdwährungs-risiko durch Skalare	Artikel 325q Absatz 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die Risikoklasse in Spalte 0010 dem Fremdwährungsrisiko und die Komponente in Spalte 0020 dem Krümmungsrisiko, ist Folgendes anzugeben: a) Wendet das Institut zur Berechnung des in den Spalten 0040 und 0060 ausgewiesenen Ergebnisses den Ansatz nach Artikel 325q Absatz 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 an, ist ‚JA' anzugeben. b) Andernfalls ist ‚NEIN' anzugeben. ‚NEIN' ist auch dann anzugeben, wenn keine dieser Möglichkeiten zutrifft.
0095	Übermittlung der Ergebnisse für die SBM-Validierungs-portfolios	Artikel 325e Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Ist das Portfolio, für das Angaben gemacht werden, ein SBM-Validierungsportfolio gemäß Anhang V Abschnitt 7, a) ist ‚Übermittelt' anzugeben, wenn das Institut Ergebnisse für dieses Portfolio meldet; b) ist ‚Nicht übermittelt – keine Risikoposition bezüglich des Risikofaktors' anzugeben, wenn das Institut keine Ergebnisse für das betreffende SBM-Validierungsportfolio meldet, da keine interne Genehmigung der Geschäftsleitung des Instituts vorliegt, in Instrumente zu investieren, mit denen eine Risikoposition bezüglich des jeweiligen Risikofaktors aufgebaut würde. ist ‚Nicht zutreffend' anzugeben, wenn das Portfolio, für das Angaben gemacht werden, ein Portfolio im Sinne von Anhang V Abschnitt 3, 4 oder 5 ist.
0100	Freitextfeld		In dieser Spalte kann das Institut zusätzliche Angaben machen.

C 120.04 – DRC. MARKTWERTE UND JTD-BRUTTOBETRÄGE NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO

Hier melden die Institute die Risikopositionen für jedes einzelne Instrument. Dabei ist für jede Risikoposition eine Zeile auszufüllen. Alle Werte sind auf das ‚letzte RM- (und das letzte ASA-)Referenzdatum' (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b Ziffer v dieser Verordnung) zu beziehen. Die Risikopositionen sind vor einer etwaigen Aufrechnung, aber, sofern anwendbar, nach Replikations- oder Aufschlüsselungsschritten (im Sinne der Artikel 325z und 325ac der Verordnung (EU) Nr. 575/2013) auszuweisen.

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Nummer des Portfolios aus Anhang V.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Nummer des Instruments	Anhang V Abschnitt 2	Angabe der Nummer des Instruments aus Anhang V.
0020	Risikoklasse	Artikel 325v Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Risikoklasse anzugeben, für die die Anforderung für das Ausfallrisiko in den Spalten 0030 und 0040 ausgewiesen wird. Auszuwählen ist eine der folgenden Arten von Instrumenten: a) ‚Instrumente, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt'; b) ‚Nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen'; c) ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen'.
0030	Unterklasse 1	Artikel 325y Absatz 3, Artikel 325aa Absatz 4 und Artikel 325ad Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Unterklasse auszuweisen. Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚Nicht-Verbriefungspositionen', ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: a) ‚Unternehmen'; b) ‚Staaten'; c) ‚Gebietskörperschaften/Kommunen'. Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse hingegen ‚Nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen', ist entweder Möglichkeit a) von oben oder eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: d) ‚ABCP – Asien'; e) ‚ABCP – Europa'; f) ‚ABCP – Nordamerika'; g) ‚ABCP – übrige Welt'; h) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings – Asien'; i) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings – Europa'; j) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings – Nordamerika'; k) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings – übrige Welt'; l) ‚Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) – Asien'; m) ‚Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) – Europa'; n) ‚Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) – Nordamerika'; o) ‚Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) – übrige Welt'; p) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere – Asien'; q) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere – Europa'; r) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere – Nordamerika'; s) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere – übrige Welt'; t) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) – Asien'; u) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) – Europa'; v) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) – Nordamerika'; w) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) – übrige Welt'; x) ‚Kreditkarten – Asien'; y) ‚Kreditkarten – Europa'; z) ‚Kreditkarten – Nordamerika'; aa) ‚Kreditkarten – übrige Welt'; bb) ‚Sonstige Privatkundenkredite – Asien'; cc) ‚Sonstige Privatkundenkredite – Europa'; dd) ‚Sonstige Privatkundenkredite – Nordamerika';

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			ee) ‚Sonstige Privatkundenkredite – übrige Welt‘; ff) ‚Sonstige Großkundenkredite – Asien‘; gg) ‚Sonstige Großkundenkredite – Europa‘; hh) ‚Sonstige Großkundenkredite – Nordamerika‘; ii) ‚Sonstige Großkundenkredite – übrige Welt‘; jj) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) – Asien‘; kk) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) – Europa‘; ll) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) – Nordamerika‘; mm) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) – übrige Welt‘; nn) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) – Asien‘; oo) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) – Europa‘; pp) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) – Nordamerika‘; qq) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) – übrige Welt‘; rr) ‚Studiendarlehen – Asien‘; ss) ‚Studiendarlehen – Europa‘; tt) ‚Studiendarlehen – Nordamerika‘; uu) ‚Studiendarlehen– übrige Welt‘. Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse hingegen ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘, so ist ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘ anzugeben.
0040	Unterklasse 2	Artikel 325ad Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen‘, so ist die Bezeichnung des Index oder andernfalls ‚NUL‘ anzugeben.
0050	Schuldner	Artikel 325v Absatz 2, Artikel 325x Absatz 1 sowie Artikel 325z und 325ac der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Banken melden Angaben zum Schuldner. Ist die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse — ‚Instrumente, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt‘, so ist der Name des Schuldners anzugeben; — ‚Nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘, so ist der Name des Schuldners oder eine eindeutige Kennung des zugrunde liegenden Aktiva-Pools und der Tranche anzugeben; — ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen‘, so ist die eindeutige Kennung der Indexfamilie,-reihe und -tranche anzugeben;
0060	Bonitätskategorie	Artikel 325y Absätze 1 und 2, Artikel 325aa Absatz 1 und Artikel 325ad Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier geben die Institute die Bonitätsstufe an. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) ‚Bonitätsstufe 1‘; b) ‚Bonitätsstufe 2‘; c) ‚Bonitätsstufe 3‘; d) ‚Bonitätsstufe 4‘; e) ‚Bonitätsstufe 5‘; f) ‚Bonitätsstufe 6‘; g) ‚Keine zugewiesene Bonitätsstufe (unbeurteilt)‘;

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			h) ‚Keine zugewiesene Bonitätsstufe (ausgefallen)'; i) ‚Keine zugewiesene Bonitätsstufe (Risikogewicht 0 %)'. Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen' oder ‚Nicht in das Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen', so ist entweder eine der vorgenannten Möglichkeiten oder Folgendes anzugeben: j) ‚Bonitätsstufe 7'; k) ‚Bonitätsstufe 8'; l) ‚Bonitätsstufe 9'; m) ‚Bonitätsstufe 10'; n) ‚Bonitätsstufe 11'; o) ‚Bonitätsstufe 12'; p) ‚Bonitätsstufe 13'; q) ‚Bonitätsstufe 14'; r) ‚Bonitätsstufe 15'; s) ‚Bonitätsstufe 16'; t) ‚Bonitätsstufe 17'; u) ‚Alle sonstigen Bonitätsstufen';
0070	Ausfallrisiko-gewicht	Artikel 325v Absatz 1 Buchstabe f, Artikel 325y Absätze 1 und 2, Artikel 325aa Absatz 1 und Artikel 325ad Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier geben die Institute das einschlägige Risikogewicht an. Die auf Verbriefungspositionen angewandten Risikogewichte sind gemäß Artikel 325aa Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 nach der Multiplikation mit 8 % auszuweisen.
0080	Rang	Artikel 325w Absätze 3 und 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist der Rang der Risikoposition anzugeben: Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt' oder ‚Nicht in das Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen', so ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: a) ‚Eigenkapitalinstrumente'; b) ‚Nicht vorrangige Schuldtitel'; c) ‚Vorrangige Schuldtitel'; d) ‚Gedeckte Schuldverschreibungen'. Trifft keine der vorstehenden Möglichkeiten zu, ist das Feld leer zu lassen.
0090	Laufzeit	Artikel 325x, 325z und 325ac der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist der Fälligkeitstermin der Risikoposition anzugeben. Hierbei ist die Konvention ‚TT/MM/JJJJ' zu befolgen.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0100	Erlösquote	Artikel 325v Absatz 1 Buchstabe e der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier geben die Institute die Erlösquote an. Die Erlösquote wird anhand der anwendbaren Verlustquote bei Ausfall (LGD) berechnet als Erlösquote = 1 - LGD. Die gemeldete Erlösquote ist mit einer Genauigkeit von mindestens vier Dezimalstellen als Dezimalwert zwischen 0 und 1 anzugeben.
0110	Richtung	Artikel 325v Absatz 1 Buchstaben a und b der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier geben die Institute die Richtung der Risikoposition im Sinne der Begriffsbestimmungen in Artikel 325v Absatz 1 Buchstaben a und b der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 an. Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: a) ‚Short-Risikoposition'; b) ‚Long-Risikoposition'.
0120	Unterer Tranchierungs-punkt (%)	Artikel 325aa und 325ad der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Bezieht sich die ausgewiesene Risikoposition auf eine Tranche, müssen die Institute den unteren Tranchierungspunkt der Tranche angeben. Die gemeldete Zahl ist mit einer Genauigkeit von mindestens vier Dezimalstellen anzugeben.
0130	Oberer Tranchierungs-punkt (%)	Artikel 325aa und 325ad der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Bezieht sich die ausgewiesene Risikoposition auf eine Tranche, müssen die Institute den oberen Tranchierungspunkt der Tranche angeben. Die gemeldete Zahl ist mit einer Genauigkeit von mindestens vier Dezimalstellen anzugeben.
0140-0170	Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung		Die Werte sind bezogen auf die Währung der Rechnungslegung des Instituts und mit einer Genauigkeit von mindestens zwei Dezimalstellen, sofern anwendbar, anzugeben.
0140	Nominalbetrag	Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt', geben die Institute den Nominalbetrag des Instruments an. Der angegebene Wert muss, je nach Risikoposition, entweder dem Term $V_{notional}$ in Artikel 325w Absätze 1 und 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder dem Term V in Artikel 325w Absatz 5 der genannten Verordnung entsprechen. Trifft keiner dieser Fälle zu oder wird der in dieser Spalte auszuweisende Betrag vom Institut nicht ausdrücklich berechnet oder zur Schätzung des Jump-to-Default-(JTD-)Bruttobetrags herangezogen, so ist dieses Feld leer zu lassen.
0150	GuV + Anpassung (P&L + Adjustment)	Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Institute geben für jede Risikoposition die Summe aus GuV und Anpassung an: — Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt' und ist die ausgewiesene Risikoposition eine Long-Risikoposition, so geben die Institute gemäß Artikel 325w Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 die Summe aus $P\&L_{long}$ und $Adjustment_{long}$ an. — Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt' und ist die ausgewiesene Risikoposition eine Short-Risikoposition, so geben die Institute gemäß Artikel 325w Absatz 2 der genannten Verordnung die Summe aus $P\&L_{short}$ und $Adjustment_{short}$ an.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			Trifft keiner dieser Fälle zu oder wird der in dieser Spalte auszuweisende Betrag vom Institut nicht ausdrücklich berechnet oder zur Schätzung des JTD-Bruttobetrags herangezogen, so ist dieses Feld leer zu lassen.
0160	JTD-Brutto-betrag	Artikel 325v Absatz 1 Buchstabe c, Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5, Artikel 325z Absatz 1 und Artikel 325ac Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier geben die Institute den JTD-Bruttobetrag für die jeweilige Risikoposition an.
0170	Währung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217).
0180-0200	Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung sowie Artikel 325y, 325aa und 325ad der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0030 anzugeben, allerdings umgerechnet zum EZB-Kassakurs für die Währung des Portfolios im Sinne von Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung.
0180	Nominalbetrag	Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0020 ausgewiesene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt', geben die Institute den Nominalbetrag des Instruments an. Der angegebene Wert muss, je nach Risikoposition, entweder dem Term $V_{notional}$ in Artikel 325w Absätze 1 und 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder dem Term V in Artikel 325w Absatz 5 der genannten Verordnung entsprechen. Trifft keiner dieser Fälle zu oder wird der in dieser Spalte auszuweisende Betrag vom Institut nicht ausdrücklich berechnet oder zur Schätzung des JTD-Bruttobetrags herangezogen, so ist dieses Feld leer zu lassen.
0190	GuV + Anpassung (P&L + Adjustment)	Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Institute geben für jede Risikoposition die Summe aus GuV und Anpassung an: — Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt' und ist die ausgewiesene Risikoposition eine Long-Risikoposition, so geben die Institute gemäß Artikel 325w Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 die Summe aus $P\&L_{long}$ und $Adjustment_{long}$ an. — Entspricht die in Spalte 0020 angegebene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt' und ist die ausgewiesene Risikoposition eine Short-Risikoposition, so geben die Institute gemäß Artikel 325w Absatz 2 der genannten Verordnung die Summe aus $P\&L_{short}$ und $Adjustment_{short}$ an.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			Trifft keiner dieser Fälle zu oder wird der in dieser Spalte auszuweisende Betrag vom Institut nicht ausdrücklich berechnet oder zur Schätzung des JTD-Bruttobetrags herangezogen, so ist dieses Feld leer zu lassen.
0200	JTD-Bruttobetrag	Artikel 325v Absatz 1 Buchstabe c, Artikel 325w Absätze 1, 2 und 5, Artikel 325z Absatz 1 und Artikel 325ac Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier geben die Institute den Jump-to-Default-(JTD-)Bruttobetrag an.

C 120.05 — DRC. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Nummer des Portfolios aus Anhang V.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Risikoklasse	Artikel 325v Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Risikoklasse anzugeben, für die die Anforderungen für das Ausfallrisiko in den Spalten 0030 und 0040 ausgewiesen werden. Auszuwählen ist eine der folgenden Arten von Instrumenten: a) ‚Instrumente, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt'; b) ‚Nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen'; c) ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen'.
0020	Unterklasse 1	Artikel 325y Absatz 3, Artikel 325aa Absatz 4 und Artikel 325ad Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Hier ist die Unterklasse auszuweisen. Entspricht die in Spalte 0010 ausgewiesene Risikoklasse ‚Instrumenten, bei denen es sich nicht um Verbriefungspositionen handelt', ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: a) ‚Unternehmen'; b) ‚Staaten'; c) ‚Gebietskörperschaften/Kommunen'.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			Entspricht die in Spalte 0010 ausgewiesene Risikoklasse hingegen ‚Nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen', ist eine der folgenden Möglichkeiten anzugeben: d) ‚ABCP – Asien'; e) ‚ABCP – Europa'; f) ‚ABCP – Nordamerika'; g) ‚ABCP – übrige Welt'; h) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings – Asien'; i) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings – Europa'; j) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings – Nordamerika'; k) ‚Kfz-Darlehen und -Leasings – übrige Welt'; l) ‚Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) – Asien'; m) ‚Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) – Europa'; n) ‚Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) – Nordamerika'; o) ‚Quadrierte forderungsbesicherte Schuldverschreibungen (CDO-squared) – übrige Welt'; p) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere – Asien'; q) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere – Europa'; r) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere – Nordamerika'; s) ‚Durch einen Anleihepool besicherte Wertpapiere – übrige Welt'; t) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) – Asien'; u) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) – Europa'; v) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) – Nordamerika'; w) ‚Durch Gewerbeimmobilien besicherte Wertpapiere (CMBS) – übrige Welt'; x) ‚Kreditkarten – Asien'; y) ‚Kreditkarten – Europa'; z) ‚Kreditkarten – Nordamerika'; aa) ‚Kreditkarten – übrige Welt'; bb) ‚Sonstige Privatkundenkredite – Asien'; cc) ‚Sonstige Privatkundenkredite – Europa'; dd) ‚Sonstige Privatkundenkredite – Nordamerika'; ee) ‚Sonstige Privatkundenkredite – übrige Welt'; ff) ‚Sonstige Großkundenkredite – Asien'; gg) ‚Sonstige Großkundenkredite – Europa'; hh) ‚Sonstige Großkundenkredite – Nordamerika'; ii) ‚Sonstige Großkundenkredite – übrige Welt'; jj) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) – Asien'; kk) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) – Europa'; ll) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) – Nordamerika'; mm) ‚Durch private Wohnimmobilien besicherte Wertpapiere (RMBS) – übrige Welt'; nn) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) – Asien'; oo) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) – Europa'; pp) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) – Nordamerika'; qq) ‚Kleine und mittlere Unternehmen (KMU) – übrige Welt'; rr) ‚Studiendarlehen – Asien';

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			ss) ‚Studiendarlehen – Europa'; tt) ‚Studiendarlehen – Nordamerika'; uu) ‚Studiendarlehen– übrige Welt'. Entspricht die in Spalte 0010 ausgewiesene Risikoklasse ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen', so ist ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Verbriefungspositionen' anzugeben.
0030	Unterklasse 2	Artikel 325ad Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Entspricht die in Spalte 0010 ausgewiesene Risikoklasse ‚In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen', so ist die Bezeichnung des Index anzugeben oder das Feld leer zu lassen (‚NUL').
0040	Eigenmittel-anforderungen (Ergebnisse in der Währung der Rechnungs-legung)	Artikel 325y, 325aa und 325ad der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderungen für das Ausfallrisiko sind zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum' (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben. Die Werte sind in der Währung der Rechnungslegung des Instituts und mit einer Genauigkeit von mindestens zwei Dezimalstellen anzugeben.
0050	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217).
0060	Eigenmittel-anforderungen (Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung)	Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung sowie Artikel 325y, 325aa und 325ad der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Werte sind gemäß den Erläuterungen zu Spalte 0030 anzugeben, allerdings umgerechnet zum EZB-Kassakurs für die Währung des Portfolios im Sinne von Anhang V Abschnitte 3 und 4 dieser Verordnung.

C 120.06 – ASA. OFR

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Portfolionummer	Anhang V Abschnitte 3, 4 und 5	Angabe der Nummer des Portfolios aus Anhang V.
0020-0040	Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung	Anhang V Abschnitte 3 und 4	

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0020	SBM OFR	Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die nach der sensitivitätsgestützten Methode des alternativen Standardansatzes ermittelte Eigenmittelanforderung ist für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum' (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.
0030	DRC OFR	Artikel 325v der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderung für das Ausfallrisiko beim alternativen Standardansatz ist für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-) Referenzdatum' (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.
0040	RRAO OFR	Artikel 325u der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderungen für den Aufschlag für Restrisiken beim alternativen Standardansatz sind für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum' (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.
0050-0070	Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung	Anhang V Abschnitte 3 und 4	Verwendet das Institut für seine Rechnungslegung eine andere als die in Anhang V Abschnitte 3 und 4 genannten EBA-Portfolio-Währungen, so rechnet es seine Rechnungslegungswährung zum anwendbaren EZB-Kassakurs um.
0050	SBM OFR	Artikel 325h der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die nach der sensitivitätsgestützten Methode des alternativen Standardansatzes ermittelte Eigenmittelanforderung ist für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum' (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.
0060	DRC OFR	Artikel 325v der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderung für das Ausfallrisiko beim alternativen Standardansatz ist für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-) Referenzdatum' (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.
0070	RRAO OFR	Artikel 325u der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Eigenmittelanforderungen für den Aufschlag für Restrisiken beim alternativen Standardansatz sind für jedes Portfolio zum ‚letzten RM- (und letzten ASA-)Referenzdatum' (im Sinne von Anhang V Abschnitt 1 Buchstabe b dieser Verordnung) anzugeben.

Tabelle: Hinweise zum Ausfüllen der Meldebögen 106.01 (Spalte 0010) und 120.01 (Spalte 0020)

— Die Spalte ‚Risikoklasse' bezieht sich auf Artikel 325d Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Für die Risikoklassen werden die folgenden Abkürzungen verwendet:

a) ‚GIRR' (allgemeines Zinsrisiko);

b) ‚CSR_NON_SEC' (Kreditspreadrisiko (CSR) bei Nicht-Verbriefungspositionen);

c) ‚CSR_SEC_NON_ACTP' (Kreditspreadrisiko bei nicht in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR Nicht-ACTP));

d) ‚CSR_SEC_ACTP' (Kreditspreadrisiko bei in das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogenen Verbriefungspositionen (CSR ACTP));

e) ‚EQ' (Aktienkursrisiko);

f) ‚CM' (Warenpositionsrisiko);

g) ‚FX' (Fremdwährungsrisiko).

— Die Spalte ‚Komponente' bezieht sich auf Artikel 325e Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Für die Komponenten der sensitivitätsgestützten Methode werden die folgenden Abkürzungen verwendet:

a) ‚DELTA' (Delta-Risiko);

b) ‚VEGA' (Vega-Risiko);

c) ‚CURVATURE' (Krümmungsrisiko).

— Die Spalte ‚Laufzeit' bezieht sich auf die Laufzeit des Risikofaktors, wobei die Risikofaktoren nach den Artikeln 325l, 325m, 325n, 325o, 325p und 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anhand spezifizierter Scheitelpunkte definiert werden. Bei Vega-Risikofaktoren des allgemeinen Zinsrisikos im Sinne von Artikel 325l Absatz 7 der genannten Verordnung sind zwei Laufzeiten mit Trennstrich anzugeben (z. B. ‚0,5 Jahre – 0,5 Jahre'), wobei die erste Angabe der Laufzeit der Option und die zweite der Restlaufzeit des Basiswerts der Option zum Ablaufdatum der Option entspricht.

— In der Spalte ‚Zusätzliche Angaben' sind genauere Angaben zum jeweiligen Risikofaktor einzutragen mit Blick auf die Unterscheidung zwischen Risikofaktoren des Inflationsrisikos und des Basis-Währungsrisikos im Sinne von Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, zwischen Risikofaktoren bei Schuldtiteln und bei Kreditausfallswaps im Sinne von Artikel 325m und 325n der genannten Verordnung, zwischen Risikofaktoren des Eigenkapital-Kassakurses und des Eigenkapital-Reposatzes im Sinne von Artikel 325o der genannten Verordnung und zwischen der Aufwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk+) und der Abwärts-Nettokrümmungsrisikoposition dieses Risikofaktors (CVRk-) im Sinne von Artikel 325g der genannten Verordnung.

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CM	DELTA	0 Jahre		CM_D_00.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	0,25 Jahre		CM_D_00.25	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	0,5 Jahre		CM_D_00.50	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	1 Jahr		CM_D_01.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	2 Jahre		CM_D_02.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	3 Jahre		CM_D_03.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	5 Jahre		CM_D_05.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	10 Jahre		CM_D_10.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	15 Jahre		CM_D_15.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	20 Jahre		CM_D_20.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	DELTA	30 Jahre		CM_D_30.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	0,5 Jahre		CM_V_00.50	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	1 Jahr		CM_V_01.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	3 Jahre		CM_V_03.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	5 Jahre		CM_V_05.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	VEGA	10 Jahre		CM_V_10.00	Artikel 325p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CM	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	CM_CU	Artikel 325p und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CM	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	CM_CD	Artikel 325p und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 Jahre	Schuldtitel	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 Jahr	Schuldtitel	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 Jahre	Schuldtitel	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 Jahre	Schuldtitel	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 Jahre	Schuldtitel	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 Jahr	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 Jahre		CSR_NON_SEC_V_00.50	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	1 Jahr		CSR_NON_SEC_V_01.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	3 Jahre		CSR_NON_SEC_V_03.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	5 Jahre		CSR_NON_SEC_V_05.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	10 Jahre		CSR_NON_SEC_V_10.00	Artikel 325m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CU	Artikel 325m und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	CSR_NON_SEC_CD	Artikel 325m und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 Jahr	Schuldtitel	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 Jahr	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 Jahr		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 Jahre		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CU	Artikel 325n und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CD	Artikel 325n und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	1 Jahr	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	3 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	5 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	10 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	1 Jahr	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	3 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	DELTA	10 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	0,5 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	1 Jahr		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	3 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	5 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	VEGA	10 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NON_ACTP	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Artikel 325n und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Artikel 325n und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	DELTA		Kassakurs	EQ_D_SPOT	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	DELTA		Reposatz	EQ_D_REPO	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	0,5 Jahre		EQ_V_00.50	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	1 Jahr		EQ_V_01.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	3 Jahre		EQ_V_03.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	5 Jahre		EQ_V_05.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	VEGA	10 Jahre		EQ_V_10.00	Artikel 325o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	EQ_CU	Artikel 325o und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
EQ	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	EQ_CD	Artikel 325o und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	DELTA			FX_D	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	0,5 Jahre		FX_V_00.50	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	1 Jahr		FX_V_01.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	3 Jahre		FX_V_03.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	5 Jahre		FX_V_05.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	VEGA	10 Jahre		FX_V_10.00	Artikel 325q der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
FX	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	FX_CU	Artikel 325q und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
FX	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	FX_CD	Artikel 325q und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	0,25 Jahre		GIRR_D_00.25	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	0,5 Jahre		GIRR_D_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	1 Jahr		GIRR_D_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	2 Jahre		GIRR_D_02.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	3 Jahre		GIRR_D_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	5 Jahre		GIRR_D_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	10 Jahre		GIRR_D_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	15 Jahre		GIRR_D_15.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	20 Jahre		GIRR_D_20.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA	30 Jahre		GIRR_D_30.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Inflation	GIRR_D_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_D_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	DELTA		Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_D_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre – 0,5 Jahre		GIRR_V_00.50_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr – 0,5 Jahre		GIRR_V_01.00_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre – 0,5 Jahre		GIRR_V_03.00_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
GIRR	VEGA	5 Jahre – 0,5 Jahre		GIRR_V_05.00_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre – 0,5 Jahre		GIRR_V_10.00_00.50	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre – 1 Jahr		GIRR_V_00.50_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr – 1 Jahr		GIRR_V_01.00_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre – 1 Jahr		GIRR_V_03.00_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre – 1 Jahr		GIRR_V_05.00_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre – 1 Jahr		GIRR_V_10.00_01.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre – 3 Jahre		GIRR_V_00.50_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr – 3 Jahre		GIRR_V_01.00_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre – 3 Jahre		GIRR_V_03.00_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre – 3 Jahre		GIRR_V_05.00_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre – 3 Jahre		GIRR_V_10.00_03.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre – 5 Jahre		GIRR_V_00.50_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr – 5 Jahre		GIRR_V_01.00_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre – 5 Jahre		GIRR_V_03.00_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre – 5 Jahre		GIRR_V_05.00_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre – 5 Jahre		GIRR_V_10.00_05.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
GIRR	VEGA	0,5 Jahre – 10 Jahre		GIRR_V_00.50_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr – 10 Jahre		GIRR_V_01.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre – 10 Jahre		GIRR_V_03.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre – 10 Jahre		GIRR_V_05.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre – 10 Jahre		GIRR_V_10.00_10.00	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre	Inflation	GIRR_V_00.50_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr	Inflation	GIRR_V_01.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre	Inflation	GIRR_V_03.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre	Inflation	GIRR_V_05.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre	Inflation	GIRR_V_10.00_INF	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	3 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre	Basis-Währung (gegenüber EUR)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	1 Jahr	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

Risikoklasse	Komponente	Laufzeit	Zusätzliche Angaben	Risikofaktor-Kennung	Rechtsgrundlage
GIRR	VEGA	3 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	5 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	VEGA	10 Jahre	Basis-Währung (gegenüber USD)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Artikel 325l der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	GIRR_CU	Artikel 325l und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
GIRR	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	GIRR_CD	Artikel 325l und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013“

ANHANG IV

”

ANHANG VII

Ergebnisse der aufsichtlichen Referenzportfolios. MARKTRISIKO

ERGEBNISSE REFERENZPORTFOLIOS. MARKTRISIKO			
Meldebogennummer	**Meldebogencode**	**Bezeichnung des Meldebogens/der Meldebogengruppe**	**Kurzbezeichnung**
		URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG	
106,1	C 106.00	URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG UND GRÜNDE FÜR DIE NICHTEINBEZIEHUNG	IMV
106,2	C 106.01	RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT	SENSITIVITÄTEN
		VaR, sVaR und PV	
107,1	C 107.01	NÄHERE ANGABEN	VaR&SVaR 1
107,2	C 107.02	ERGEBNISSE **EBA-PORTFOLIO**-WÄHRUNG	VaR&SVaR 2
		GEWINN- UND VERLUST-ZEITREIHEN	
108	C 108.00	GEWINN- UND VERLUST-ZEITREIHEN	GuV
		EIGENKAPITALANFORDERUNGEN FÜR ZUSÄTZLICHE RISIKEN (IRC)	
109,1	C 109.01	IRC. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL	IRC 1
109,2	C 109.02	IRC. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS	IRC 2
109,3	C 109.03	IRC. BETRAG PRO PORTFOLIO/DATUM	IRC 3
		KORRELATIONSHANDEL (CT)	
110,1	C 110.01	CT. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL	CT 1
110,2	C 110.02	CT. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS	CT 2
110,3	C 110.03	CT. BETRAG PRO PORTFOLIO/DATUM	CT 3
		ASA (SBM & DRC)	
120,1	C 120.01	SBM. RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO	SBM 1
120,2	C 120.02	SBM. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO	SBM 2
120,4	C 120.04	DRC. MARKTWERTE UND JTD-BRUTTOBETRÄGE NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO	DRC 1
120,5	C 120.05	DRC. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO	DRC 2
120,6	C 120.06	ASA. OFR NACH PORTFOLIO	ASA OFR

C 106.00 – URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG UND GRÜNDE FÜR DIE NICHTEINBEZIEHUNG

Nummer des Instruments	Modellierung des Instruments für VaR und sVaR (Ja/Nein)	Modellierung des Instruments für IRC (Ja/Nein)	Modellierung des Instruments für Korrelationshandel (Ja/Nein)	Grund für die Nichteinbeziehung	Freitextfeld	Ursprüngliche Marktbewertung
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 106.01 – RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT

Nummer des Instruments

Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Währung der Rechnungslegung	Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung des EBA-Instruments)	Bewertungsmodell	Definition der Sensitivitäten	Freitextfeld	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

C 107.01 – VaR, sVaR und PV. NÄHERE ANGABEN

		Option	Freitextfeld
		0010	0020
VaR			
0010	**Methodik**		
0020	**Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen**		

		Option	Freitextfeld
		0010	0020
0030	**Länge des Beobachtungszeitraums**		
0040	**Datengewichtung**		
0050	**Backtesting-Zuschlagsfaktor**		
0060	**Aufsichtlicher VaR-Zuschlagsfaktor**		
sVaR			
0070	**Methodik**		
0080	**Berechnung des Zeithorizonts von 10 Tagen**		
0090	**Aufsichtlicher sVaR-Zuschlagsfaktor**		
0100	**sVaR-Zeitraum**		

C 107.02 – VaR und SVaR NICHT-CTP. ERGEBNISSE EBA-PORTFOLIO-WÄHRUNG

Portfolio

Datum	VaR	sVaR	PV
0010	0020	0030	0040

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 108.00 – GEWINN- UND VERLUST-ZEITREIHEN

Portfolio

Datum	**Tägliche GuV**
0010	0020

C 109.01 – IRC. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL

		Option	**Freitext-feld**
Zeile	**Posten**	0010	0020
0010	**Anzahl der Modellierungs-faktoren**		
0020	**Herkunft der LGDs**		

C 109.02 – IRC. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS

Portfolio

		Option	Freitext-feld
Zeile	**Posten**	0010	0020
0010	**Liquiditätshorizont**		
0020	**Herkunft der PDs**		
0030	**Herkunft der Übergangs-matrizen**		

C 109.03 – IRC. BETRAG PRO PORTFOLIO/DATUM

Portfolio

Datum	IRC
0010	0020

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 110.01 – CT. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL

		Option	Freitextfeld
Zeile	**Posten**	0010	0020
0010	**Anzahl der Modellierungs-faktoren**		
0020	**Herkunft der LGDs**		

C 110.02 – CT. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS

Portfolio

		Option	Freitextfeld
Zeile	**Posten**	0010	0020
0010	**Liquiditätshorizont**		
0020	**Herkunft der PDs**		
0030	**Herkunft der Übergangs-matrizen**		

C 110.03 – CT. APR NACH PORTFOLIO/DATUM

Portfolio

Datum	**APR**
0010	0060

C 120.01 — SBM. RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO

Portfolio

Nummer des Instruments	**Risikofaktor-Kennung**	**Unterklasse**	**Zusätzliche Kennung**	**Risikosensitivität (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)**	**Währung der Rechnungslegung**	**Risikosensitivität (Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung)**	**Risikogewicht**	**Zusätzliche Kennung 2**	**Bonitätskategorie**
0010	0020	0030	0040	0060	0070	0080	0090	110	120

C 120.02 – SBM. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO

Portfolio

Risikoklasse	Risikokomponente	Korrelationsszenario	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Währung der Rechnungslegung	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung)	Positionen ohne Optionalität, die Eigenmittelanforderungen in Bezug auf das Krümmungsrisiko unterliegen	Basiswährungsansatz für Delta-Faktor- und Krümmungsrisikofaktoren des Fremdwährungsrisikos	Division der Krümmungsrisikokomponenten für das Fremdwährungsrisiko durch Skalare	Übermittlung der Ergebnisse für die SBM-Validierungsportfolios	Freitextfeld
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

C 120.04 – DRC. Marktwerte und JTD-Bruttobeträge nach Instrument/Portfolio

Portfolio

Integer

Nummer des Instruments	Risikoklasse	Unterklasse 1	Unterklasse 2	Schuldner	Bonitätskategorie	Ausfallrisikogewicht	Rang	Laufzeit	Erlösquote	Richtung	Unterer Tranchierungspunkt (%)	Oberer Tranchierungspunkt (%)	Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung				Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung		
													Nominalbetrag	GuV + Anpassung (P&L + Adjustment)	JTD-Bruttobetrag	Währung	Nominalbetrag	GuV + Anpassung (P&L + Adjustment)	JTD-Bruttobetrag
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

C 120.05 — DRC. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO

Portfolio

Integer

Risikoklasse	Unterklasse 1	Unterklasse 2	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Währung der Rechnungslegung	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 120.06 — ASA. OFR

Portfolionummer	Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung			Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung		
	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

”

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

ANHANG V

"ANHANG X

SBM-Validierungsportfolios

Datenblattname	Beschreibung
Instrumente	Instrumente (Sensitivitäten und Krümmungsrisikopositionen) für die SBM-Validierung
Portfolios	SBM-Validierungsportfolios, definiert als Kombinationen aus den in diesem Anhang definierten Instrumenten

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_IRV_b25#	GIRR_V_10.00_10.00	USD				400,00
S_IRV_b24#	GIRR_V_10.00_05.00	USD				200,00
S_IRV_b23#	GIRR_V_10.00_03.00	USD				– 900,00
S_IRV_b22#	GIRR_V_10.00_01.00	USD				950,00
S_IRV_b21#	GIRR_V_10.00_00.50	USD				– 350,00
S_IRV_b20#	GIRR_V_05.00_10.00	USD				1 000,00
S_IRV_b19#	GIRR_V_05.00_05.00	USD				– 300,00
S_IRV_b18#	GIRR_V_05.00_03.00	USD				50,00
S_IRV_b17#	GIRR_V_05.00_01.00	USD				300,00
S_IRV_b16#	GIRR_V_05.00_00.50	USD				– 50,00
S_IRV_e3#	GIRR_V_03.00_CRO_USD	BRL				500,00
S_IRV_b15#	GIRR_V_03.00_10.00	USD				– 400,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_IRV_b14#	GIRR_V_03.00_05.00	USD				700,00
S_IRV_b13#	GIRR_V_03.00_03.00	USD				– 800,00
S_IRV_b12#	GIRR_V_03.00_01.00	USD				700,00
S_IRV_b11#	GIRR_V_03.00_00.50	USD				– 100,00
S_IRV_e2#	GIRR_V_01.00_INF	BRL				750,00
S_IRV_b10#	GIRR_V_01.00_10.00	USD				500,00
S_IRV_b9#	GIRR_V_01.00_05.00	USD				50,00
S_IRV_b8#	GIRR_V_01.00_03.00	USD				– 500,00
S_IRV_b7#	GIRR_V_01.00_01.00	USD				200,00
S_IRV_b6#	GIRR_V_01.00_00.50	USD				900,00
S_IRV_b5#	GIRR_V_00.50_10.00	USD				100,00
S_IRV_c5#	GIRR_V_00.50_10.00	CLP				– 100,00
S_IRV_d5#	GIRR_V_00.50_10.00	EUR				– 2 000,00
S_IRV_b4#	GIRR_V_00.50_05.00	USD				100,00
S_IRV_c4#	GIRR_V_00.50_05.00	CLP				100,00
S_IRV_d4#	GIRR_V_00.50_05.00	EUR				1 500,00
S_IRV_b3#	GIRR_V_00.50_03.00	USD				– 500,00
S_IRV_c3#	GIRR_V_00.50_03.00	CLP				– 300,00
S_IRV_d3#	GIRR_V_00.50_03.00	EUR				1 000,00
S_IRV_b2#	GIRR_V_00.50_01.00	USD				400,00
S_IRV_c2#	GIRR_V_00.50_01.00	CLP				150,00
S_IRV_d2#	GIRR_V_00.50_01.00	EUR				3 750,00
S_IRV_a1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				– 100,00
S_IRV_b1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				700,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_IRV_c1#	GIRR_V_00.50_00.50	CLP				300,00
S_IRV_d1#	GIRR_V_00.50_00.50	EUR				– 4 750,00
S_IRV_e1#	GIRR_V_00.50_00.50	BRL				– 500,00
S_IRD_b11#	GIRR_D_INF	USD				– 50 000,00
S_IRD_d11#	GIRR_D_INF	CLP				95 000,00
S_IRD_e11#	GIRR_D_INF	EUR	DE			– 65 000,00
S_IRD_e13#	GIRR_D_INF	EUR	FR			– 100 000,00
S_IRD_d12#	GIRR_D_CRO_USD	CLP				10 500,00
S_IRD_e12#	GIRR_D_CRO_USD	EUR				– 85 000,00
S_IRD_b12#	GIRR_D_CRO_EUR	USD				– 65 000,00
S_IRD_b10#	GIRR_D_30.00	USD	OIS			– 50 000,00
S_IRD_c10#	GIRR_D_30.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d10#	GIRR_D_30.00	CLP	OIS			15 000,00
S_IRD_e10#	GIRR_D_30.00	EUR	OIS			– 120 000,00
S_IRD_b9#	GIRR_D_20.00	USD	OIS			200 000,00
S_IRD_c9#	GIRR_D_20.00	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d9#	GIRR_D_20.00	CLP	OIS			90 000,00
S_IRD_e9#	GIRR_D_20.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b8#	GIRR_D_15.00	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_c8#	GIRR_D_15.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d8#	GIRR_D_15.00	CLP	OIS			70 000,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_IRD_e8#	GIRR_D_15.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b7#	GIRR_D_10.00	USD	OIS			2 000,00
S_IRD_c7#	GIRR_D_10.00	USD	Libor3m			– 100 000,00
S_IRD_d7#	GIRR_D_10.00	CLP	OIS			– 25 000,00
S_IRD_e7#	GIRR_D_10.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b6#	GIRR_D_05.00	USD	OIS			– 90 000,00
S_IRD_c6#	GIRR_D_05.00	USD	Libor3m			– 35 000,00
S_IRD_d6#	GIRR_D_05.00	CLP	OIS			– 5 000,00
S_IRD_e6#	GIRR_D_05.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b5#	GIRR_D_03.00	USD	OIS			85 000,00
S_IRD_c5#	GIRR_D_03.00	USD	Libor3m			55 000,00
S_IRD_d5#	GIRR_D_03.00	CLP	OIS			– 100 000,00
S_IRD_e5#	GIRR_D_03.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b4#	GIRR_D_02.00	USD	OIS			– 10 000,00
S_IRD_c4#	GIRR_D_02.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d4#	GIRR_D_02.00	CLP	OIS			5 000,00
S_IRD_e4#	GIRR_D_02.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b3#	GIRR_D_01.00	USD	OIS			– 65 000,00
S_IRD_c3#	GIRR_D_01.00	USD	Libor3m			70 000,00
S_IRD_d3#	GIRR_D_01.00	CLP	OIS			10 000,00
S_IRD_e3#	GIRR_D_01.00	EUR	OIS			– 50 000,00
S_IRD_b2#	GIRR_D_00.50	USD	OIS			15 000,00
S_IRD_c2#	GIRR_D_00.50	USD	Libor3m			– 40 000,00
S_IRD_d2#	GIRR_D_00.50	CLP	OIS			45 000,00
S_IRD_e2#	GIRR_D_00.50	EUR	OIS			100,00
S_IRD_a1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_b1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			20 000,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_IRD_c1#	GIRR_D_00.25	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d1#	GIRR_D_00.25	CLP	OIS			– 30 000,00
S_IRD_e1#	GIRR_D_00.25	EUR	OIS			100,00
S_IRD_f1#	GIRR_D_00.25	DKK	OIS			100,00
S_IRC_a1#	GIRR_CU	USD				– 18 466,83
S_IRC_b1#	GIRR_CU	USD				92 233,09
S_IRC_c1#	GIRR_CU	CLP				– 1 270,00
S_IRC_d1#	GIRR_CU	EUR				– 253,12
S_IRC_e1#	GIRR_CU	VND				– 11 950,00
S_IRC_a1#	GIRR_CD	USD				18 647,66
S_IRC_b1#	GIRR_CD	USD				– 93 178,71
S_IRC_c1#	GIRR_CD	CLP				450,00
S_IRC_d1#	GIRR_CD	EUR				– 3 237,08
S_IRC_e1#	GIRR_CD	VND				– 4 030,00
S_FXV_b4#	FX_V_5.00	EUR_CLP				200,00
S_FXV_d4#	FX_V_5.00	CHF_VND				1 500,00
S_FXV_b3#	FX_V_3.00	EUR_CLP				– 400,00
S_FXV_d3#	FX_V_3.00	CHF_VND				1 000,00
S_FXV_b5#	FX_V_10.00	EUR_CLP				150,00
S_FXV_d5#	FX_V_10.00	CHF_VND				– 2 000,00
S_FXV_b2#	FX_V_1.00	EUR_CLP				300,00
S_FXV_d2#	FX_V_1.00	CHF_VND				3 750,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_FXV_a1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				– 100,00
S_FXV_b1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				700,00
S_FXV_c1#	FX_V_0.50	AUD_JPY				450,00
S_FXV_d1#	FX_V_0.50	CHF_VND				– 4 800,00
S_FXD_a1#	FX_D	GBP				5 000,00
S_FXD_b1#	FX_D	GBP				– 8 000,00
S_FXD_c1#	FX_D	CLP				3 000,00
S_FXD_d1#	FX_D	DKK				1 000,00
S_FXD_f1#	FX_D	BGN				1 000,00
S_FXC_a1#	FX_CU	EUR				– 16 037,91
S_FXC_b1#	FX_CU	EUR				80 159,24
S_FXC_c1#	FX_CU	CLP				– 800,00
S_FXC_d1#	FX_CU	JPY				– 1 472,88
S_FXC_e1#	FX_CU	VND				– 3 400,00
S_FXC_f1#	FX_CU	DKK				– 48,61
S_FXC_a1#	FX_CD	EUR				16 162,18
S_FXC_b1#	FX_CD	EUR				– 80 723,02
S_FXC_c1#	FX_CD	CLP				700,00
S_FXC_d1#	FX_CD	JPY				– 1 324,35
S_FXC_e1#	FX_CD	VND				– 2 100,00
S_FXC_f1#	FX_CD	DKK				48,61
S_EQV_a5#	EQ_V_5.00	1	EMITTENT A			100,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	EMITTENT AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	EMITTENT AC			– 50,00
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	EMITTENT AE			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	EMITTENT AF			375,00
S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	EMITTENT B			50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	EMITTENT F			450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	EMITTENT J			– 200,00
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	EMITTENT K			– 825,00
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	EMITTENT M			– 700,00
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	INDEX N			850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	INDEX O			150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	EMITTENT Y			700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	EMITTENT A			– 500,00
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	EMITTENT AA			– 850,00
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	EMITTENT AD			300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	EMITTENT AE			– 450,00
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	EMITTENT AF			– 725,00
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	EMITTENT B			– 500,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	EMITTENT F			250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	EMITTENT J			– 900,00
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	EMITTENT K			– 975,00
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	INDEX N			– 1 250,00
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	INDEX O			100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	EMITTENT X			– 200,00
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	EMITTENT Z			– 800,00
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	EMITTENT A			100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	EMITTENT AA			– 300,00
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	EMITTENT AB			– 400,00
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	EMITTENT AE			– 850,00
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	EMITTENT AF			525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	EMITTENT B			500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	EMITTENT F			600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	EMITTENT J			150,00
S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	EMITTENT K			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	INDEX N			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	INDEX O			– 200,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	INDEX Q			– 800,00
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	EMITTENT A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	EMITTENT AA			– 400,00
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	EMITTENT AE			– 250,00
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	EMITTENT AF			– 1 150,00
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	EMITTENT B			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	EMITTENT F			– 750,00
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	EMITTENT J			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	EMITTENT K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	INDEX N			– 800,00
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	INDEX O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	EMITTENT A			– 100,00
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	EMITTENT A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	EMITTENT AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	EMITTENT AE			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	EMITTENT AF			– 300,00
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	EMITTENT B			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	EMITTENT C			– 500,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	EMITTENT D			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	EMITTENT E			– 800,00
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	EMITTENT F			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	EMITTENT G			– 400,00
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	EMITTENT H			– 50,00
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	EMITTENT I			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	EMITTENT J			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	EMITTENT K			– 300,00
S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	EMITTENT L			1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	INDEX N			750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	INDEX O			– 500,00
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	INDEX P			40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	EMITTENT A			16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	EMITTENT A			– 35 000,00
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	EMITTENT B			20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	EMITTENT C			66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	EMITTENT D			1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	EMITTENT E			1 100,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	EMITTENT F			25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	EMITTENT G			8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	EMITTENT H			22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	EMITTENT I			– 12 300,00
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	EMITTENT J			– 450,00
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	EMITTENT K			– 143,00
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	EMITTENT L			– 143,00
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	EMITTENT M			– 100,00
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	EMITTENT N			– 100,00
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	EMITTENT O			– 19 600,00
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	INDEX Q			1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	INDEX R			– 40 000,00
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	INDEX S			– 1 950,00
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	INDEX S			280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	INDEX T			3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	EMITTENT U			– 57,00
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	EMITTENT V			– 100,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	EMITTENT A			50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	EMITTENT AA			79 000,00
S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	EMITTENT AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	EMITTENT AC			– 10 000,00
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	EMITTENT B			– 39 000,00
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	EMITTENT F			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	EMITTENT G			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	EMITTENT K			– 14 250,00
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	EMITTENT L			– 150 000,00
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	EMITTENT M			– 85 000,00
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	EMITTENT N			– 72 000,00
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	EMITTENT P			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	INDEX Q			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	INDEX R			– 40 000,00
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	INDEX T			– 125 000,00
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	EMITTENT X			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	EMITTENT Y			4 800,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_EQD_z1#	EQ_D_REPO	4	EMITTENT Z			– 15 000,00
S_EQC_a1#	EQ_CU	1	EMITTENT A			– 37 820,00
S_EQC_a2#	EQ_CU	1	EMITTENT A			77 655,00
S_EQC_aa1#	EQ_CU	2	EMITTENT AA			39 300,00
S_EQC_ab1#	EQ_CU	4	EMITTENT AB			17 262,00
S_EQC_ac1#	EQ_CU	5	EMITTENT AC			7 139,60
S_EQC_ad1#	EQ_CU	6	EMITTENT AD			– 3 642,50
S_EQC_ae1#	EQ_CU	7	EMITTENT AE			3 900,00
S_EQC_af1#	EQ_CU	8	EMITTENT AF			41 550,00
S_EQC_ag1#	EQ_CU	9	EMITTENT AG			36 860,00
S_EQC_ah1#	EQ_CU	10	EMITTENT AH			22 150,00
S_EQC_b1#	EQ_CU	1	EMITTENT B			20 677,50
S_EQC_c1#	EQ_CU	2	EMITTENT C			– 31 440,00
S_EQC_d1#	EQ_CU	3	EMITTENT D			6 238,00
S_EQC_e1#	EQ_CU	4	EMITTENT E			– 21 605,00
S_EQC_f1#	EQ_CU	5	EMITTENT F			– 2 850,00
S_EQC_g1#	EQ_CU	6	EMITTENT G			– 3 642,50

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_EQC_h1#	EQ_CU	7	EMITTENT H			– 7 800,00
S_EQC_i1#	EQ_CU	8	EMITTENT I			– 29 550,00
S_EQC_j1#	EQ_CU	9	EMITTENT J			– 216 320,00
S_EQC_k1#	EQ_CU	10	EMITTENT K			1 950,00
S_EQC_q1#	EQ_CU	11	EMITTENT Q			– 19 142,00
S_EQC_r1#	EQ_CU	11	EMITTENT R			28 713,00
S_EQC_s1#	EQ_CU	3	EMITTENT S			– 17 025,00
S_EQC_t1#	EQ_CU	12	EMITTENT T			7 466,67
S_EQC_u1#	EQ_CU	13	EMITTENT U			11 160,00
S_EQC_v1#	EQ_CU	12	EMITTENT V			– 39 200,00
S_EQC_w1#	EQ_CU	13	EMITTENT W			– 58 590,00
S_EQC_y1#	EQ_CU	1	EMITTENT Y			– 23 930,00
S_EQC_z1#	EQ_CU	1	EMITTENT Z			– 47 860,00
S_EQC_a1#	EQ_CD	1	EMITTENT A			39 157,50
S_EQC_a2#	EQ_CD	1	EMITTENT A			– 80 349,00
S_EQC_aa1#	EQ_CD	2	EMITTENT AA			– 30 600,00
S_EQC_ab1#	EQ_CD	4	EMITTENT AB			– 9 826,00
S_EQC_ac1#	EQ_CD	5	EMITTENT AC			– 5 414,60

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_EQC_ad1#	EQ_CD	6	EMITTENT AD			2 617,50
S_EQC_ae1#	EQ_CD	7	EMITTENT AE			– 2 720,00
S_EQC_af1#	EQ_CD	8	EMITTENT AF			– 28 250,00
S_EQC_ag1#	EQ_CD	9	EMITTENT AG			– 30 935,00
S_EQC_ah1#	EQ_CD	10	EMITTENT AH			– 15 025,00
S_EQC_b1#	EQ_CD	1	EMITTENT B			– 238 910,00
S_EQC_c1#	EQ_CD	2	EMITTENT C			24 480,00
S_EQC_d1#	EQ_CD	3	EMITTENT D			– 6 068,00
S_EQC_e1#	EQ_CD	4	EMITTENT E			12 310,00
S_EQC_f1#	EQ_CD	5	EMITTENT F			2 160,00
S_EQC_g1#	EQ_CD	6	EMITTENT G			2 617,50
S_EQC_h1#	EQ_CD	7	EMITTENT H			5 440,00
S_EQC_i1#	EQ_CD	8	EMITTENT I			20 050,00
S_EQC_j1#	EQ_CD	9	EMITTENT J			181 560,00
S_EQC_k1#	EQ_CD	10	EMITTENT K			– 2 900,00
S_EQC_q1#	EQ_CD	11	EMITTENT Q			20 052,00
S_EQC_r1#	EQ_CD	11	EMITTENT R			– 30 078,00
S_EQC_s1#	EQ_CD	3	EMITTENT S			– 9 435,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	EMITTENT T			– 7 400,00
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	EMITTENT U			– 11 040,00
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	EMITTENT V			38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	EMITTENT W			57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	EMITTENT Y			13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	EMITTENT Z			27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	EMITTENT A			100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	EMITTENT B			50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	EMITTENT C			150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	EMITTENT HA			– 750,00
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	EMITTENT A			– 500,00
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	EMITTENT AB			325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	EMITTENT B			– 500,00
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	EMITTENT C			100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	INDEX V			500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	EMITTENT A			100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	EMITTENT B			500,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	EMITTENT C			– 200,00
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	EMITTENT A			400,00
S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	EMITTENT B			200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	EMITTENT C			400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITTENT A			– 100,00
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITTENT A			700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITTENT B			900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	EMITTENT C			– 500,00
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	EMITTENT D			700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	EMITTENT E			– 800,00
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	EMITTENT F			700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	EMITTENT G			– 400,00
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	EMITTENT H			– 50,00
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	EMITTENT I			300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	EMITTENT J			50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	EMITTENT K			– 300,00
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	EMITTENT L			1 000,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	EMITTENT M			– 350,00
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	EMITTENT N			950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	EMITTENT O			– 900,00
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	EMITTENT P			200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	EMITTENT Q			400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	EMITTENT R			– 300,00
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEX S			850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	INDEX T			– 650,00
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	INDEX U			– 350,00
S_CND_hb2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_DEBT	9	EMITTENT HB			– 17 000,00
S_CND_t1#	CSR_NON_SEC_D_3.00_DEBT	3	EMITTENT T			– 6 000,00
S_CND_y1#	CSR_NON_SEC_D_3.00_DEBT	20	INDEX Y			9 000,00
S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	EMITTENT AC			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	EMITTENT B			– 17 000,00
S_CND_w1#	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	10	EMITTENT W		CQS 1	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_SEC_D_1.00_DEBT	1	EMITTENT A			– 10 000,00
S_CND_s1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_DEBT	3	EMITTENT S			– 6 000,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	INDEX X			– 18 500,00
S_CND_a1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITTENT A			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITTENT A			– 30 000,00
S_CND_b1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITTENT B			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	3	EMITTENT C			– 6 000,00
S_CND_d1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	4	EMITTENT D			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	5	EMITTENT E			– 4 000,00
S_CND_f1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	6	EMITTENT F			– 8 000,00
S_CND_g1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	7	EMITTENT G			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	8	EMITTENT H			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	9	EMITTENT HA			– 23 000,00
S_CND_i1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	10	EMITTENT I		CQS 2	– 5 000,00
S_CND_j1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	11	EMITTENT J			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	12	EMITTENT K			7 000,00
S_CND_l1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	13	EMITTENT L			– 9 000,00
S_CND_m1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	14	EMITTENT M			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	15	EMITTENT N			– 20 000,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CND_o1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	16	EMITTENT O			5 000,00
S_CND_p1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	17	EMITTENT P			– 3 000,00
S_CND_q1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	18	EMITTENT Q			10 000,00
S_CND_r1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	18	EMITTENT R			– 5 000,00
S_CND_a3#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	1	EMITTENT A			15 000,00
S_CND_ab1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	2	EMITTENT AB			21 000,00
S_CND_u1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDEX U			– 32 000,00
S_CND_v1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	20	INDEX V			– 13 000,00
S_CND_x2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	INDEX X			52 500,00
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITTENT A			– 2 338,64
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITTENT A			35 116,67
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CU	10	EMITTENT AA		CQS 1	– 1 212,50
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CU	2	EMITTENT AB1			– 247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITTENT B			890,91
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CU	3	EMITTENT C			– 500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CU	4	EMITTENT D			415,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CU	5	EMITTENT E			– 1 050,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CU	6	EMITTENT F			– 150,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CU	7	EMITTENT G			– 318,75
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CU	8	EMITTENT H			– 425,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CU	9	EMITTENT HB1			– 500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CU	10	EMITTENT I		CQS 2	– 937,50
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CU	11	EMITTENT J			– 4 650,00
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CU	12	EMITTENT K			– 425,00
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CU	13	EMITTENT L			– 27 660,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CU	14	EMITTENT M			– 488,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CU	15	EMITTENT N			13 237,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CU	16	EMITTENT O			– 1 127,50
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CU	17	EMITTENT P			– 5 775,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CU	18	EMITTENT Q			– 7 842,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CU	18	EMITTENT R			15 684,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CU	4	EMITTENT S			– 750,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CU	19	EMITTENT T			3 550,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CU	20	EMITTENT U			1 660,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CU	19	EMITTENT V			– 18 637,50

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CU	20	EMITTENT W			– 8 715,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CU	3	EMITTENT X			– 500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITTENT Y			– 249,95
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITTENT Z			– 249,95
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITTENT A			2 363,38
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITTENT A			– 35 314,65
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CD	10	EMITTENT AA		CQS 1	1 150,00
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CD	2	EMITTENT AB1			247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITTENT B			– 5 543,43
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CD	3	EMITTENT C			500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CD	4	EMITTENT D			– 385,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CD	5	EMITTENT E			575,00
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CD	6	EMITTENT F			75,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CD	7	EMITTENT G			287,50
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CD	8	EMITTENT H			400,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CD	9	EMITTENT HB1			500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CD	10	EMITTENT I		CQS 2	750,00
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CD	11	EMITTENT J			4 100,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	EMITTENT K			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	EMITTENT L			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	EMITTENT M			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	EMITTENT N			– 23 437,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	EMITTENT O			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	EMITTENT P			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	EMITTENT Q			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	EMITTENT R			– 17 504,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	EMITTENT S			– 250,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	EMITTENT T			– 3 500,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	EMITTENT U			– 1 540,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	EMITTENT V			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	EMITTENT W			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	EMITTENT X			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITTENT Y			– 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITTENT Z			– 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	KOHLE			– 300,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	URAN			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	KOHLE			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	URAN			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	KOHLE			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	URAN			– 250,00
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	KOHLE			– 200,00
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	URAN			– 750,00
S_CMV_d1#	CM_V_1.00	2	WTI			– 175,00
S_CMV_f1#	CM_V_1.00	3	FWD ELECTRICITY NE			– 450,00
S_CMV_h1#	CM_V_1.00	4	PANAMAX			– 5 500,00
S_CMV_j1#	CM_V_1.00	5	KUPFER			– 200,00
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	FLÜSSIGERDGAS (LNG)			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	SILBER			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	MAIS			– 1 000,00
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	MOLKE			– 125,00
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	KAUTSCHUK			– 50,00
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	KALI			– 1 800,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	KOHLE			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	KOHLE			– 350,00
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	URAN			150,00
S_CMV_c1#	CM_V_0.50	2	BRENT			200,00
S_CMV_e1#	CM_V_0.50	3	SPOT ELECTRICITY SE			– 300,00
S_CMV_g1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_i1#	CM_V_0.50	5	STAHL			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	ERDGAS			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	GOLD			– 200,00
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	SOJABOHNEN			– 750,00
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	FISCH			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	KAKAO			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	FLACHGLAS			3 000,00
S_CMV_w1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_x1#	CM_V_0.50	4	PANAMAX			15 000,00
S_CMD_p1#	CM_D_30.00	8	MAIS	OKLAHOMA		– 10 000,00
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FWD ELECTRICITY NE	TEXAS		– 4 500,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		– 68 750,00
S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	SILBER	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	MOLKE	NEWCASTLE		– 1 250,00
S_CMD_d1#	CM_D_2.00	2	WTI	OKLAHOMA		– 1 750,00
S_CMD_l1#	CM_D_15.00	6	FLÜSSIGERDGAS (LNG)	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	KAUTSCHUK	NEWCASTLE		– 500,00
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	KUPFER	OKLAHOMA		– 2 000,00
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	KALI	NEWCASTLE		– 18 000,00
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	URAN	OKLAHOMA		1 500,00
S_CMD_g1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		– 62 500,00
S_CMD_w1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		– 62 500,00
S_CMD_x1#	CM_D_1.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		187 500,00
S_CMD_a4#	CM_D_0.50	1	KOHLE	NEWCASTLE		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	KOHLE	NEWCASTLE		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	KOHLE	NEWCASTLE		– 3 500,00
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	KOHLE	LONDON		– 2 000,00
S_CMD_c1#	CM_D_0.00	2	BRENT	LE HAVRE		2 000,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	SPOT ELECTRICITY SE	LONDON		– 3 000,00
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	STAHL	LE HAVRE		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	ERDGAS	LE HAVRE		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	GOLD	UK1		– 2 000,00
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	SOJABOHNEN	LE HAVRE		– 7 500,00
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	FISCH	LONDON		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	KAKAO	LONDON		3 500,00
S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	FLACHGLAS	LONDON		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	KOHLE			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	KOHLE			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	URAN			6 635,00
S_CMC_c1#	CM_CU	2	BRENT			– 11 600,00
S_CMC_d1#	CM_CU	2	WTI			– 36 900,00
S_CMC_e1#	CM_CU	3	SPOT ELECTRICITY SE			8 563,00
S_CMC_f1#	CM_CU	3	FWD ELECTRICITY NE			– 27 250,00
S_CMC_g1#	CM_CU	4	SUPRAMAX			– 36 880,00
S_CMC_h1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CMC_i1#	CM_CU	5	STAHL			– 5 850,00
S_CMC_j1#	CM_CU	5	KUPFER			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	ERDGAS			– 6 147,50
S_CMC_l1#	CM_CU	6	FLÜSSIGERDGAS (LNG)			– 6 147,50
S_CMC_m1#	CM_CU	7	GOLD			– 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	SILBER			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	SOJABOHNEN			– 14 535,00
S_CMC_p1#	CM_CU	8	MAIS			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	FISCH			– 19 900,00
S_CMC_r1#	CM_CU	9	MOLKE			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	KAKAO			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	KAUTSCHUK			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	FLACHGLAS			– 13 790,00
S_CMC_v1#	CM_CU	11	KALI			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	MILCH			– 6 300,00
S_CMC_y1#	CM_CU	1	URAN			– 65 864,00
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CMC_a1#	CM_CD	1	KOHLE			– 18 260,00
S_CMC_a2#	CM_CD	1	KOHLE			– 37 630,00
S_CMC_b1#	CM_CD	1	URAN			– 70 460,00
S_CMC_c1#	CM_CD	2	BRENT			8 320,00
S_CMC_d1#	CM_CD	2	WTI			3 550,00
S_CMC_e1#	CM_CD	3	SPOT ELECTRICITY SE			– 8 233,00
S_CMC_f1#	CM_CD	3	FWD ELECTRICITY NE			16 370,00
S_CMC_g1#	CM_CD	4	SUPRAMAX			29 110,00
S_CMC_h1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 15 256,00
S_CMC_i1#	CM_CD	5	STAHL			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	KUPFER			– 10 219,80
S_CMC_k1#	CM_CD	6	ERDGAS			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	FLÜSSIGERDGAS (LNG)			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	GOLD			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	SILBER			– 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	SOJABOHNEN			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	MAIS			– 14 735,00

Instrument	Risikofaktor-Kennung	Unterklasse	Zusätzliche Kennung	Zusätzliche Kennung 2	Bonitätskategorie	Risikosensitivität
S_CMC_q1#	CM_CD	9	FISCH			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	MOLKE			– 3 012,00
S_CMC_s1#	CM_CD	10	KAKAO			– 1 415,00
S_CMC_t1#	CM_CD	10	KAUTSCHUK			– 7 817,20
S_CMC_u1#	CM_CD	11	FLACHGLAS			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	KALI			– 21 300,00
S_CMC_x1#	CM_CD	9	MILCH			– 4 700,00
S_CMC_y1#	CM_CD	1	URAN			– 66 344,00
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 22 856,00

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
G000	GIRR	DELTA	S_IRD_a1#
G001	GIRR	DELTA	S_IRD_b1#
G002	GIRR	DELTA	S_IRD_b2#
G003	GIRR	DELTA	S_IRD_b3#
G004	GIRR	DELTA	S_IRD_b4#
G005	GIRR	DELTA	S_IRD_b5#
G006	GIRR	DELTA	S_IRD_b6#
G007	GIRR	DELTA	S_IRD_b7#
G008	GIRR	DELTA	S_IRD_b8#
G009	GIRR	DELTA	S_IRD_b9#
G010	GIRR	DELTA	S_IRD_b10#
G011	GIRR	DELTA	S_IRD_b11#
G012	GIRR	DELTA	S_IRD_b12#
G013	GIRR	DELTA	S_IRD_d1#
G014	GIRR	DELTA	S_IRD_d2#
G015	GIRR	DELTA	S_IRD_d3#
G016	GIRR	DELTA	S_IRD_d4#
G017	GIRR	DELTA	S_IRD_d5#
G018	GIRR	DELTA	S_IRD_d6#
G019	GIRR	DELTA	S_IRD_d7#
G020	GIRR	DELTA	S_IRD_d8#
G021	GIRR	DELTA	S_IRD_d9#
G022	GIRR	DELTA	S_IRD_d10#
G023	GIRR	DELTA	S_IRD_d11#
G024	GIRR	DELTA	S_IRD_d12#
G025	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1#
G026	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10#
G027	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_c1#
G028	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
G029	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11#
G030	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12#
G031	GIRR	DELTA	S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c6#
G032	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12#
G033	GIRR	DELTA	S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13#
G034	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1#
G035	GIRR	VEGA	S_IRV_b1#
G036	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1#
G037	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5#
G038	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b6# S_IRV_b11# S_IRV_b16# S_IRV_b21#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
G039	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25#
G040	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e2#
G041	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e3#
G042	GIRR	VEGA	S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G043	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5#
G044	GIRR	VEGA	S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G045	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3#
G046	GIRR	CURVATURE	S_IRC_b1#
G047	GIRR	CURVATURE	S_IRC_c1#
G048	GIRR	CURVATURE	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	GIRR	CURVATURE	S_IRC_d1#
G050	GIRR	CURVATURE	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	GIRR	CURVATURE	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	GIRR	CURVATURE	S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G053	GIRR	CURVATURE	S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
G054	GIRR	ALL	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1# S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3# S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#
G055	GIRR	DELTA	S_IRD_e11# S_IRD_e13#
G056	GIRR	DELTA	S_IRD_e1# S_IRD_f1#
E001	EQ	DELTA	S_EQD_a2#
E002	EQ	DELTA	S_EQD_c1#
E003	EQ	DELTA	S_EQD_d1#
E004	EQ	DELTA	S_EQD_e1#
E005	EQ	DELTA	S_EQD_f1#
E006	EQ	DELTA	S_EQD_h1#
E007	EQ	DELTA	S_EQD_i1#
E008	EQ	DELTA	S_EQD_j1#
E009	EQ	DELTA	S_EQD_k1#
E010	EQ	DELTA	S_EQD_m1#
E011	EQ	DELTA	S_EQD_o1#
E012	EQ	DELTA	S_EQD_q1#
E013	EQ	DELTA	S_EQD_s1#
E014	EQ	DELTA	S_EQD_a3#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
E015	EQ	DELTA	S_EQD_x1#
E016	EQ	DELTA	S_EQD_y1#
E017	EQ	DELTA	S_EQD_z1#
E018	EQ	DELTA	S_EQD_f2#
E019	EQ	DELTA	S_EQD_aa1#
E020	EQ	DELTA	S_EQD_ab1#
E021	EQ	DELTA	S_EQD_ac1#
E022	EQ	DELTA	S_EQD_k2#
E023	EQ	DELTA	S_EQD_m2#
E024	EQ	DELTA	S_EQD_p1#
E025	EQ	DELTA	S_EQD_q2#
E026	EQ	DELTA	S_EQD_t1#
E027	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2#
E028	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_a3#
E029	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b1#
E030	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b2#
E031	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_f2#
E032	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g1#
E033	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g2#
E034	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_k2#
E035	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1#
E036	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l2#
E037	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_m2#
E038	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n1#
E039	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n2#
E040	EQ	DELTA	S_EQD_o1# S_EQD_p1#
E041	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_q2#
E042	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_r1#
E043	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1#
E044	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1# S_EQD_t2#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
E045	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_c1# S_EQD_d1# S_EQD_e1# S_EQD_f1# S_EQD_h1# S_EQD_i1# S_EQD_j1# S_EQD_k1# S_EQD_m1#
E046	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_o1#
E047	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_s1#
E048	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_q1#
E049	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1# S_EQD_m1# S_EQD_n1# S_EQD_q1# S_EQD_s2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E050	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E051	EQ	VEGA	S_EQV_a2#
E052	EQ	VEGA	S_EQV_c1#
E053	EQ	VEGA	S_EQV_d1#
E054	EQ	VEGA	S_EQV_e1#
E055	EQ	VEGA	S_EQV_f1#
E056	EQ	VEGA	S_EQV_g1#
E057	EQ	VEGA	S_EQV_h1#
E058	EQ	VEGA	S_EQV_i1#
E059	EQ	VEGA	S_EQV_j1#
E060	EQ	VEGA	S_EQV_k1#
E061	EQ	VEGA	S_EQV_l1#
E062	EQ	VEGA	S_EQV_n1#
E063	EQ	VEGA	S_EQV_p1#
E064	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2#
E065	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6#
E066	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_b1#
E067	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
E068	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5#
E069	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_aa1#
E070	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5#
E071	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#
E072	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_ae1#
E073	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5#
E074	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5#
E075	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_af1#
E076	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5#
E077	EQ	VEGA	S_EQV_l1# S_EQV_m1#
E078	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5#
E079	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_o1#
E080	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E081	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E082	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_c1# S_EQV_d1# S_EQV_e1# S_EQV_f1# S_EQV_g1# S_EQV_h1# S_EQV_i1# S_EQV_j1# S_EQV_k1#
E083	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_m1#
E084	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_p1#
E085	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_n1#
E086	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
E087	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1#
E088	EQ	CURVATURE	S_EQC_b1#
E089	EQ	CURVATURE	S_EQC_c1#
E090	EQ	CURVATURE	S_EQC_d1#
E091	EQ	CURVATURE	S_EQC_e1#
E092	EQ	CURVATURE	S_EQC_f1#
E093	EQ	CURVATURE	S_EQC_g1#
E094	EQ	CURVATURE	S_EQC_h1#
E095	EQ	CURVATURE	S_EQC_i1#
E096	EQ	CURVATURE	S_EQC_j1#
E097	EQ	CURVATURE	S_EQC_k1#
E098	EQ	CURVATURE	S_EQC_q1#
E099	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1#
E100	EQ	CURVATURE	S_EQC_u1#
E101	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	CURVATURE	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	CURVATURE	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	CURVATURE	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	CURVATURE	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1# S_EQC_v1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
E108	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E109	EQ	CURVATURE	S_EQC_s1#
E110	EQ	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_c1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_f1# S_EQC_g1# S_EQC_h1# S_EQC_i1# S_EQC_j1# S_EQC_k1#
E111	EQ	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_q1#
E112	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E113	EQ	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_t1#
E114	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1#
E115	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E116	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
E117	EQ	ALL	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1# S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
			S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1# S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
F001	FX	DELTA	S_FXD_b1#
F002	FX	DELTA	S_FXD_c1#
F003	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1#
F005	FX	DELTA	S_FXD_b1# S_FXD_c1#
F007	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1#
F008	FX	VEGA	S_FXV_b1#
F009	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1#
F010	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5#
F011	FX	VEGA	S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F012	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1#
F013	FX	VEGA	S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F014	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
F015	FX	CURVATURE	S_FXC_b1#
F016	FX	CURVATURE	S_FXC_c1#
F017	FX	CURVATURE	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	FX	CURVATURE	S_FXC_d1#
F019	FX	CURVATURE	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	FX	CURVATURE	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	FX	CURVATURE	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	FX	CURVATURE	S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F023	FX	ALL	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1# S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F024	FX	DELTA	S_FXD_d1#
F026	FX	DELTA	S_FXD_f1#
F028	FX	CURVATURE	S_FXC_f1#
N001	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1#
N002	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_c1#
N003	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_d1#
N004	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_e1#
N005	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1#
N006	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_g1#
N007	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_h1#
N008	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_i1#
N009	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_w1#
N010	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1#
N011	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_k1#
N012	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_l1#
N013	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_m1#
N014	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
N015	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_o1#
N016	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_p1#
N017	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1#
N018	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1#
N019	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1#
N020	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2#
N021	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a3#
N022	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a4#
N023	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_a4#
N024	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b1#
N025	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1#
N026	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a4# S_CND_b1#
N027	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b2#
N028	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1# S_CND_r1#
N029	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x2#
N030	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1# S_CND_y1#
N031	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x1# S_CND_x2#
N032	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1#
N033	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N034	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N035	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N036	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N037	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N038	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N039	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N040	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
N041	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N042	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1# S_CND_c1# S_CND_s1# S_CND_t1#
N043	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1#
N044	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2#
N045	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2#
N046	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6#
N047	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_b1#
N048	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5#
N049	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_q1# S_CNV_r1#
N050	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_s1# S_CNV_u1#
N051	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_t1# S_CNV_v1#
N052	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N053	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1#
N054	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N055	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N056	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N057	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N058	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N059	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
N060	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N061	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N062	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N063	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_b4# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N064	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1#
N065	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_h1#
N072	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_p1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
N081	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1#
N092	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N093	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N094	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N095	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N096	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N097	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N098	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N099	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N100	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
N103	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#
N104	CSR_NON_SEC	ALL	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1# S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1# S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
N104(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_ab1#
N105(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_hb1#
N106(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_ab1#
N107(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_hb1#
C001	CM	DELTA	S_CMD_a2#
C002	CM	DELTA	S_CMD_c1#
C003	CM	DELTA	S_CMD_e1#
C004	CM	DELTA	S_CMD_g1#
C005	CM	DELTA	S_CMD_i1#
C006	CM	DELTA	S_CMD_k1#
C007	CM	DELTA	S_CMD_m1#
C008	CM	DELTA	S_CMD_o1#
C009	CM	DELTA	S_CMD_q1#
C010	CM	DELTA	S_CMD_s1#
C011	CM	DELTA	S_CMD_u1#
C012	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2#
C013	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a3#
C014	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a4#
C015	CM	DELTA	S_CMD_a3# S_CMD_a4#
C016	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_b1#
C017	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1#
C018	CM	DELTA	S_CMD_e1# S_CMD_f1#
C019	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1#
C020	CM	DELTA	S_CMD_i1# S_CMD_j1#
C021	CM	DELTA	S_CMD_k1# S_CMD_l1#
C022	CM	DELTA	S_CMD_m1# S_CMD_n1#
C023	CM	DELTA	S_CMD_o1# S_CMD_p1#
C024	CM	DELTA	S_CMD_q1# S_CMD_r1#
C025	CM	DELTA	S_CMD_s1# S_CMD_t1#
C026	CM	DELTA	S_CMD_u1# S_CMD_v1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
C027	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C028	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_c1# S_CMD_e1# S_CMD_g1# S_CMD_i1# S_CMD_k1# S_CMD_m1# S_CMD_o1# S_CMD_q1# S_CMD_s1#
C029	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_u1#
C030	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C031	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C032	CM	VEGA	S_CMV_a2#
C033	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2#
C034	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6#
C035	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5#
C036	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1#
C037	CM	VEGA	S_CMV_e1# S_CMV_f1#
C038	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1#
C039	CM	VEGA	S_CMV_i1# S_CMV_j1#
C040	CM	VEGA	S_CMV_k1# S_CMV_l1#
C041	CM	VEGA	S_CMV_m1# S_CMV_n1#
C042	CM	VEGA	S_CMV_o1# S_CMV_p1#
C043	CM	VEGA	S_CMV_q1# S_CMV_r1#
C044	CM	VEGA	S_CMV_s1# S_CMV_t1#
C045	CM	VEGA	S_CMV_u1# S_CMV_v1#
C046	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C047	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_c1# S_CMV_e1# S_CMV_g1# S_CMV_i1# S_CMV_k1# S_CMV_m1# S_CMV_o1# S_CMV_q1# S_CMV_s1#
C048	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_u1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
C049	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C050	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C051	CM	CURVATURE	S_CMC_b1#
C052	CM	CURVATURE	S_CMC_c1#
C053	CM	CURVATURE	S_CMC_e1#
C054	CM	CURVATURE	S_CMC_g1#
C055	CM	CURVATURE	S_CMC_i1#
C056	CM	CURVATURE	S_CMC_k1#
C057	CM	CURVATURE	S_CMC_m1#
C058	CM	CURVATURE	S_CMC_o1#
C059	CM	CURVATURE	S_CMC_q1#
C060	CM	CURVATURE	S_CMC_s1#
C061	CM	CURVATURE	S_CMC_u1#
C062	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	CURVATURE	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	CURVATURE	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	CURVATURE	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	CURVATURE	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	CURVATURE	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	CURVATURE	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	CURVATURE	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	CURVATURE	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	CURVATURE	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	CURVATURE	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	CURVATURE	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	CURVATURE	S_CMC_g1# S_CMC_z1#

Portfolio	Risikoklasse	Komponente	Instrumente
C076	CM	CURVATURE	S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_e1# S_CMC_g1# S_CMC_i1# S_CMC_k1# S_CMC_m1# S_CMC_o1# S_CMC_q1# S_CMC_s1#
C077	CM	CURVATURE	S_CMC_a2# S_CMC_u1#
C078	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1#
C079	CM	CURVATURE	S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C080	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#
C081	CM	ALL	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#”