



2026/1872

12.8.2026

DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2026/1872 DER KOMMISSION

vom 29. Juli 2026

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 4,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Mit der Richtlinie (EU) 2024/1619 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽²⁾ wurde die Richtlinie 2013/36/EU geändert, um unter anderem Anforderungen in Bezug auf ESG-Risiken in die Richtlinie aufzunehmen und die aufsichtlichen Benchmarking-Anforderungen zu ändern. Diese Änderungen sollten sich in der Durchführungsverordnung (EU) 2016/2070 der Kommission ⁽³⁾ niederschlagen.
- (2) Mit der Delegierten Verordnung (EU) 2025/1496 der Kommission ⁽⁴⁾ wurde Artikel 520a der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽⁵⁾ geändert, um die Anwendung der Standards für die Berechnung der Eigenmittelanforderungen für das Marktrisiko, die mit der grundlegenden Überprüfung der Handelsbuchvorschriften eingeführt wurden, aufzuschieben. Infolge dieser Änderung sind die Institute verpflichtet, bis zum 1. Januar 2027 weiterhin den Marktrisikorahmen anzuwenden, der in der am 8. Juli 2024 geltenden Fassung der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 festgelegt ist. Folglich sollte der Anwendungsbereich des Benchmarkings vorübergehend auf Institute beschränkt bleiben, die die in Artikel 78 Absatz 1 Buchstabe a der Richtlinie 2013/36/EU genannten internen Ansätze (auf internen Modellen beruhender Ansatz) anwenden dürfen.
- (3) Darüber hinaus sollte die Datenerhebung für Institute, die den auf internen Modellen beruhenden Ansatz verwenden und in den Anwendungsbereich des Vergleichs der Ansätze für Marktrisiken fallen, bis zum 1. Januar 2027 auf die Elemente des alternativen Standardansatzes beschränkt bleiben. Dadurch wäre der Aufwand für die teilnehmenden Institute in diesem Zeitraum wesentlich geringer, aber es bliebe dennoch gewährleistet, dass die jährlichen Datenerhebungen vergleichbar sind und die Daten bereitgestellt werden, die von den Aufsichtsbehörden als besonders nützlich erachtet werden.

⁽¹⁾ ABL L 176 vom 27.6.2013, S. 338, ELI: <http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj>.

⁽²⁾ Richtlinie (EU) 2024/1619 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 31. Mai 2024 zur Änderung der Richtlinie 2013/36/EU im Hinblick auf Aufsichtsbefugnisse, Sanktionen, Zweigstellen aus Drittländern sowie Umwelt-, Sozial- und Unternehmensführungsrisiken (ABL L, 2024/1619, 19.6.2024, ELI: <http://data.europa.eu/eli/dir/2024/1619/oj>).

⁽³⁾ 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).

⁽⁴⁾ Delegierte Verordnung (EU) 2025/1496 der Kommission vom 12. Juni 2025 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, 2025/1496 vom 19.9.2025, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2025/1496/oj).

⁽⁵⁾ Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABL L 176 vom 27.6.2013, S. 1, ELI: <http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj>).

- (4) Die Durchführungsverordnung (EU) 2024/3117 der Kommission ⁽⁶⁾ enthält die Meldebögen für aufsichtliche Meldungen über die Anwendung des IRB-Ansatzes auf das Kreditrisiko. Daher sollte sichergestellt werden, dass beim Kreditrisiko-Benchmarking die zur Bestimmung der Benchmarking-Portfolios herangezogenen Risikopositionsklassen mit der Aufschlüsselung nach den in der genannten Durchführungsverordnung festgelegten IRB-Meldebögen für das Kreditrisiko übereinstimmen.
- (5) Die Durchführungsverordnung (EU) 2016/2070 sollte daher entsprechend geändert werden.
- (6) Die vorliegende Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Durchführungsstandards, der der Kommission von der EBA vorgelegt wurde.
- (7) 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 ⁽⁷⁾ eingesetzten Interessengruppe Bankensektor eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

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

1. Anhang II 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 29. Juli 2026

Für die Kommission
Die Präsidentin
Ursula VON DER LEYEN

⁽⁶⁾ Durchführungsverordnung (EU) 2024/3117 der Kommission vom 29. November 2024 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) 2021/451 der Kommission (ABl. L, 2024/3117, 27.12.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2024/3117/oj).

⁽⁷⁾ 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 II

AUFSICHTLICHE REFERENZPORTFOLIOS

DEFINITION OF THE SUPERVISORY BENCHMARK PORTFOLIOS	4
C 101.00 — Definition of Low Default Portfolio counterparties	4
C 102.00 — Definition of Low Default Portfolios	5
The following mapping between the exposure classes and the breakdown of the CR IRB template shall be applied:	
C 103.00 — Definition of High Default Portfolios	12
The following mapping between the exposure classes and the breakdown of the Credit Risk IRB template shall be applied:	
C 104.00 — Definition of High Default Portfolios for IFRS 9 templates	15

BESTIMMUNG DER AUFSICHTLICHEN REFERENZPORTFOLIOS

Für die Zuordnung der Risikopositionen der Institute zu Gegenparteien und zu den Portfolios nach Anhang I sind die in diesem Anhang festgelegten Spalten, Bezeichnungen, Rechtsgrundlagen und Erläuterungen zu verwenden.

Wird in Anhang I ‚Nicht zutreffend‘ („N.A.“) verwendet, so ist für die betreffende Variable keine spezifische Aufteilung erforderlich.

C 101.00 — Bestimmung der Gegenparteien eines Portfolios mit niedrigem Ausfallrisiko („LDP“)

In Anhang III Meldebogen C 101.00 sind nur die Risikopositionen gegenüber den in Anhang I Meldebogen C 101.00 Tabelle c aufgeführten Gegenparteien anzugeben, bei denen der IRB-Basisansatz oder der fortgeschrittene IRB-Ansatz angewandt wird. In Anhang VIII Meldebögen C 111.00, C 112.00 und C 113.00 sind auch die Risikopositionen gegenüber den in Anhang I Meldebogen C 101.00 Tabelle c aufgeführten Gegenparteien anzugeben, bei denen der Standardansatz angewandt wird. Risikopositionen gegenüber verbundenen Unternehmen der in Anhang I Meldebogen C 101.00 aufgeführten Gegenparteien, insbesondere auch gegenüber deren Tochterunternehmen und Muttergesellschaften, sind unabhängig vom Regelungsansatz nicht anzugeben.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Code der Gegenpartei		Code, den die EBA den in die Stichprobe der Portfolios mit niedrigem Ausfallrisiko („LDP“) einbezogenen Rechtsträgern zugewiesen hat.
0020	Rechtsträgerkennung (LEI)		20-stelliger, alphanumerischer Referenzcode, der eine klare und eindeutige Identifikation der auf den weltweiten Finanzmärkten tätigen Unternehmen ermöglicht.
0030	Code im Kreditregister		Der im zentralen Kreditregister des Sitzlandes der Gegenpartei geführte Code. Dieser Code dient als Kennung der Gegenpartei.
0040	Code im Handelsregister		Code, der der Gegenpartei im Handelsregister des Landes zugewiesen wird, in dem diese Partei ihren eingetragenen Sitz hat.
0050	ISIN-Code		‚Internationale Wertpapierkennnummer‘ („ISIN“), die zur eindeutigen Identifizierung der von der Gegenpartei emittierten Wertpapiere dient.
0060	Bloomberg-Ticker		Von Bloomberg zur eindeutigen Identifikation eines Unternehmens oder Rechtsträgers verwendete Zahlen- oder Zeichenreihe.
0070	Bezeichnung		Bezeichnung des in die LDP-Stichproben einbezogenen Rechtsträgers.
0080	Geografisches Gebiet		Sitzland (ISO-Code oder „Sonstige Länder“) der Gegenpartei (0010)
0090	Bezeichnung des Portfolios		Stichprobe, der die Gegenpartei (0010) zugeordnet wird. Zu unterscheiden ist zwischen folgenden Sektoren: a) Stichprobe Staaten; b) Stichprobe Institute; c) Stichprobe Großunternehmen.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0100	Sektor der Gegenpartei	Anhang VI der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451 der Kommission	Relevanter Wirtschaftssektor, dem die Gegenpartei (0010) zugeordnet wird. Zu unterscheiden ist zwischen folgenden Sektoren: a) Zentralbanken; b) Staaten; c) Kreditinstitute; d) Sonstige finanzielle Kapitalgesellschaften; e) Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften; f) Haushalte; g) Nicht zutreffend. Die Zuordnung der Gegenparteien zu den Sektoren erfolgt gemäß den Erläuterungen in Anhang V Abschnitt 1 Nummer 42 der Durchführungsverordnung (EU) 451/2021 der Kommission, außer bei der ‚Europäischen Investitionsbank‘, die nach Artikel 117 Absatz 2 Buchstabe j der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 als multilaterale Entwicklungsbank behandelt und daher ‚b) Staaten‘ zugeordnet wird.
0110	Art der Risikoposition		In Anhang III Meldebogen C 101.00 sind nur die Risikopositionen anzugeben, bei denen es sich nicht um Spezialfinanzierungspositionen handelt.
0120	Art der Fazilität		Nicht zutreffend: Risikopositionen sind unabhängig von der Art der Fazilität in Anhang III Meldebogen C 101.00 auszuweisen.
0130	Art des Risikos		Risikopositionen sind nach Art des Risikos aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) Gegenparteiausfallrisiko; b) Kreditrisiko und Vorleistungen; c) Kreditrisiko, Gegenparteiausfallrisiko und Vorleistungen.
0140	Regelungsansatz		Die Risikopositionen gegenüber Gegenparteien sind entsprechend dem bei der Berechnung der RWEA verwendeten Regelungsansatz aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) IRB-Basisansatz; b) Fortgeschrittener IRB-Ansatz; c) Standardansatz.

C 102.00 — Bestimmung der Portfolios mit niedrigem Ausfallrisiko („LDP“)

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Portfolio-ID		Eindeutige ID, die dem Portfolio von der EBA zugewiesen wurde.
0020	Bezeichnung des Portfolios		Jedem Portfolio wird eine der folgenden Portfolio-Bezeichnungen zugewiesen: a) Staaten; b) Institute; c) Großunternehmen; d) Spezialfinanzierungspositionen, die sämtliche in Artikel 147 Absatz 2 Buchstabe c Ziffer ii und Artikel 147 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Risikopositionen umfassen.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0030	Art des Risikos		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 101.00 Spalte 0130.
0040	Regelungsansatz		Die Risikopositionen sind entsprechend dem bei der Berechnung der RWEA verwendeten Regelungsansatz aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) IRB-Basisansatz; b) Fortgeschrittener IRB-Ansatz; c) Zuordnungskriterien für Spezialfinanzierungspositionen.
0050	Geografisches Gebiet		Die Risikopositionen sind entsprechend dem Sitzland (ISO-Code oder „Sonstige Länder“) der Schuldner aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen.
0060	Einstufung	Artikel 153 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Risikopositionen sind den internen Ratingstufen des Instituts entsprechend aufsteigend vom niedrigsten bis zum höchsten Risiko aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen. Ausgenommen sind Ausfälle mit einer Ausfallwahrscheinlichkeit („PD“) von 100 %. Für die Einstufung sind die Größen „Rating 1“, „Rating 2“ usw. zu verwenden.
		Meldebogen C 08.02 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2024/3117 der Kommission und zugehörige Erläuterungen	Verwendet das meldende Institut ein einmalig entwickeltes Ratingsystem oder kann es seine Meldungen nach einer internen Rahmenskala erstellen, so ist diese interne Rahmenskala zu verwenden. In allen anderen Fällen werden die verschiedenen Ratingsysteme zusammengeführt und nach folgenden Erläuterungen geordnet: a) Die Ratingstufen aus den verschiedenen Ratingsystemen sind in Pools zusammenzufassen und dann nach der Ausfallwahrscheinlichkeit der einzelnen Schuldner in aufsteigende Reihenfolge zu bringen; b) bei einer großen Zahl an Stufen oder Pools kann mit den zuständigen Behörden die Angabe einer geringeren Anzahl von Stufen oder Pools vereinbart werden.
			Bei Spezialfinanzierungspositionen, denen gemäß dem Ansatz nach Artikel 153 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ein Risikogewicht zugewiesen wurde, basiert die Ratingaufteilung auf der in Tabelle 1 des genannten Artikels beschriebenen aufsichtlichen Risikogewichtskategorie, wobei gilt: a) Rating 1: Kategorie 1 mit einer Restlaufzeit unter 2,5 Jahren; b) Rating 2: Kategorie 2 mit einer Restlaufzeit unter 2,5 Jahren; c) Rating 3: Kategorie 3 mit einer Restlaufzeit unter 2,5 Jahren; d) Rating 4: Kategorie 4 mit einer Restlaufzeit unter 2,5 Jahren; e) Rating 5: Kategorie 1 mit einer Restlaufzeit von 2,5 Jahren oder länger; f) Rating 6: Kategorie 2 mit einer Restlaufzeit von 2,5 Jahren oder länger; g) Rating 7: Kategorie 3 mit einer Restlaufzeit von 2,5 Jahren oder länger; h) Rating 8: Kategorie 4 mit einer Restlaufzeit von 2,5 Jahren oder länger. Es ist die Ratingskala für die Angaben in Meldebogen C 08.02 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 451/2021 zu verwenden. Verwendet das Institut eine Gruppen-Rahmenskala, ist diese Rahmenskala zu verwenden.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen																						
0070	Risikopositions- klasse	Anhang II Absatz 76 der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451	Die Risikopositionen sind entsprechend der Risikopositionsklasse aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) Zentralstaaten und Zentralbanken; b) Institute; c) Bei Risikopositionen gegenüber Unternehmen in Portfolios mit niedrigem Ausfallrisiko: c.1) Unternehmen — Allgemein; c.2) Unternehmen — Spezialfinanzierungspositionen; e) Nicht zutreffend. Es ist die folgende Zuordnung zwischen den Risikopositionsklassen und der Aufschlüsselung des Meldebogens CR IRB anzuwenden: <table><tr><th colspan="2">Risikopositionsklasse</th><th rowspan="2">Code in der Portfolio-ID</th><th rowspan="2">*</th></tr><tr><th colspan="2"></th></tr><tr><td>a)</td><td>Zentralstaaten und Zentralbanken</td><td>GOVT</td><td>A.2; B.2</td></tr><tr><td>b)</td><td>Institute</td><td>INST</td><td>A.3; A.4; A.5; B.3; B.4</td></tr><tr><td>c.1)</td><td>Unternehmen — Allgemein;</td><td>LCOR</td><td>A.6.2; A.6.3; B.5.2; B.5.3</td></tr><tr><td>c.2)</td><td>Unternehmen — Spezialfinanzierungspositionen</td><td>COSP</td><td>A.6.1; B.5.1</td></tr></table> * Durchführungsverordnung (EU) 2024/3117 der Kommission vom 29. November 2024 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) 2021/451 der Kommission (ABl. L, 2024/3117, 27.12.2024), Anhang II: Erläuterungen zur Meldung von Eigenmittelanforderungen, Teil II: Erläuterungen zu den einzelnen Meldebögen, Abschnitt 3.3.2. Risikopositionen gegenüber regionalen oder lokalen Gebietskörperschaften und öffentlichen Stellen, die wie Risikopositionen gegenüber Zentralstaaten behandelt werden, werden gemäß Artikel 147 Absatz 3a der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 der Risikopositionsklasse a (Zentralstaaten und Zentralbanken) zugeordnet. Die in Artikel 147 Absatz 2 Buchstaben e, ea, f und g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Risikopositionsklassen ‚Beteiligungsrisikopositionen‘, ‚Risikopositionen in Form von Anteilen an einem OGA‘, ‚Posten, die Verbriefungspositionen darstellen‘ und ‚sonstige Aktiva ohne Kreditverpflichtungen‘ werden nicht ausgewiesen.	Risikopositionsklasse		Code in der Portfolio-ID	*			a)	Zentralstaaten und Zentralbanken	GOVT	A.2; B.2	b)	Institute	INST	A.3; A.4; A.5; B.3; B.4	c.1)	Unternehmen — Allgemein;	LCOR	A.6.2; A.6.3; B.5.2; B.5.3	c.2)	Unternehmen — Spezialfinanzierungspositionen	COSP	A.6.1; B.5.1
Risikopositionsklasse		Code in der Portfolio-ID	*																						
a)	Zentralstaaten und Zentralbanken	GOVT	A.2; B.2																						
b)	Institute	INST	A.3; A.4; A.5; B.3; B.4																						
c.1)	Unternehmen — Allgemein;	LCOR	A.6.2; A.6.3; B.5.2; B.5.3																						
c.2)	Unternehmen — Spezialfinanzierungspositionen	COSP	A.6.1; B.5.1																						

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0080	Sektor der Gegenpartei	Anhang VI der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451	Die Risikopositionen sind entsprechend dem relevanten Wirtschaftssektor aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) Zentralbanken; b) Staaten; c) Kreditinstitute; d) Sonstige finanzielle Kapitalgesellschaften; e) Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften; f) Haushalte; g) Nicht zutreffend. Die Zuordnung der Risikopositionen zu den Sektoren erfolgt gemäß den Erläuterungen in Anhang V Abschnitt 1 Nummer 42 der Durchführungsverordnung (EU) 2021/451.
0090	Ausfallstatus		Die Risikopositionen sind entsprechend dem Ausfallstatus nach Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) Ausgefallen; b) Nicht ausgefallen; c) Nicht zutreffend.
0100	Art der Fazilität	Artikel 166 Absätze 8 und 10 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Risikopositionen sind nach Art der Fazilität aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen. Trifft auf das Kreditprodukt mehr als ein Wert für die Art von Fazilität zu, ist der Risikopositionswert nach den Fazilitätsart-Werten aufzuteilen. Es ist zwischen folgenden Arten von Fazilitäten zu unterscheiden: a) Volles Risiko (100 %); b) Absicherungsfazilitäten („note issuance facilities“) und Fazilitäten zur revolvingen Platzierung von Geldmarktpapieren („revolving underwriting facilities“) (mittleres Risiko); c) ausgestellte Erfüllungsgarantien und Freistellungen, Garantien, unwiderrufliche Kreditsicherungsgarantien („standby letters of credit“), Dokumentenakkreditive und sonstige außerbilanzielle Posten mit mittlerem Risiko (mittleres Risiko), einschließlich Bietungs-, Erfüllungs-, Zoll- und Steuerbürgschaften, Garantien, unwiderrufliche Kreditsicherungsgarantien, die nicht den Charakter von Kreditsubstituten haben, und sonstige außerbilanzielle Posten mit mittlerem Risiko; d) nicht in Anspruch genommene zugesagte revolvingende Kreditfazilität (mittleres/niedriges Risiko), einschließlich nicht in Anspruch genommene revolvingende Kreditzusagen, die nicht jederzeit uneingeschränkt und fristlos widerrufen werden können oder bei einer Verschlechterung der Bonität eines Kreditnehmers keine automatische Kündigung vorsehen; e) nicht in Anspruch genommene zugesagte befristete Kreditfazilität (mittleres/niedriges Risiko), einschließlich nicht in Anspruch genommener befristeter Kreditzusagen, die nicht jederzeit uneingeschränkt und fristlos widerrufen werden können oder bei einer Verschlechterung der Bonität eines Kreditnehmers keine automatische Kündigung vorsehen; f) sonstige nicht in Anspruch genommene zugesagte Kreditfazilität (mittleres/niedriges Risiko), einschließlich nicht in Anspruch genommener, weder befristeter noch revolvingender Kreditzusagen, die nicht jederzeit uneingeschränkt und fristlos widerrufen werden können oder bei einer Verschlechterung der Bonität eines Kreditnehmers keine automatische Kündigung vorsehen;

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			g) ausgestellte Dokumentenakkreditive mit kurzer Laufzeit und sonstige außerbilanzielle Posten mit mittlerem bis niedrigem Risiko (mittleres/niedriges Risiko); h) nicht in Anspruch genommene nicht zugesagte Kreditlinien (niedriges Risiko), einschließlich nicht in Anspruch genommener Darlehensfazilitäten, die jederzeit uneingeschränkt und fristlos widerrufen werden können oder die bei einer Verschlechterung der Bonität eines Kreditnehmers eine automatische Kündigung vorsehen; i) nicht in Anspruch genommene Kaufverpflichtungen für angekaufte revolving Forderungen und sonstige außerbilanzielle Posten mit niedrigem Risiko (niedriges Risiko), einschließlich Verbindlichkeiten, die bedingungslos kündbar sind oder effektiv eine jederzeitige fristlose automatische Kündigung durch das Institut vorsehen; j) Nicht zutreffend.
0110	Besicherungsstatus	Meldebogen C 08.01 Spalten 150 bis 220 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2024/3117 der Kommission und zugehörige Erläuterungen	Risikopositionen sind aufzuteilen und entsprechend dem Besicherungsstatus des jeweiligen Teils Portfolios zuzuordnen: a) Risikopositionen mit Sicherheitsleistung; b) Risikopositionen ohne Sicherheitsleistung; c) Nicht zutreffend. Der Teil der Risikoposition mit Sicherheitsleistung bestimmt sich durch den Wert der Sicherheit nach Abschlägen (haircuts) gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 4 Abschnitt 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 und gegebenenfalls den internen Leitlinien der Institute.
0120	Art der Sicherheit	Meldebogen C 08.01 Spalten 0040 bis 0060 und 0150 bis 0220 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2024/3117 der Kommission und zugehörige Erläuterungen	Die Risikopositionen sind entsprechend der Art der Sicherheit aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) Anrechenbare finanzielle Sicherheiten (Meldebogen C 08.01 Spalte 0180); b) Sonstige anrechenbare Sicherheiten: Forderungen (Meldebogen C 08.01 Spalte 0210); c) Sonstige anrechenbare Sicherheiten: Wohnimmobilien (Meldebogen C 08.01 Spalte 0190); d) Sonstige anrechenbare Sicherheiten: Gewerbeimmobilien (Meldebogen C 08.01 Spalte 0190); e) Sonstige anrechenbare Sicherheiten: Sachsicherheiten (Meldebogen C 08.01 Spalte 0200); f) Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistung (Meldebogen C 08.01 Spalten 0060 und 0170); g) Kreditderivate (Meldebogen C 08.01 Spalten 0050 und 0160); h) Garantien (Meldebogen C 08.01 Spalten 0040 und 0150); i) Nicht zutreffend. Der durch eine bestimmte Art von Sicherheit abgesicherte Teil der Risikoposition bestimmt sich durch den Wert der jeweiligen Art von Sicherheit nach den erforderlichen Abschlägen (haircuts) gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 4 Abschnitt 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 und gegebenenfalls den internen Leitlinien der Institute.
0130	Gegenpartei		Die Risikopositionen sind nach Art der Gegenpartei aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) Öffentliche Stellen (Artikel 4 Absätze 1 und 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013); b) Gegenparteien, bei denen es sich nicht um öffentliche Stellen handelt; c) Nicht zutreffend.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0140	Größe der Gegenpartei		Die Risikopositionen sind entsprechend der Größe der Gegenpartei aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen. Die Größe der Gegenpartei bestimmt sich nach dem Gesamtjahresumsatz der konsolidierten Gruppe, der die Gegenpartei angehört: a) ≤ 50 Mio. EUR; b) > 50 Mio. EUR und ≤ 200 Mio. EUR; c) > 200 Mio. EUR; d) > 200 Mio. EUR und ≤ 500 Mio. EUR; e) > 500 Mio. EUR; f) Nicht zutreffend. Der Gesamtjahresumsatz ist gemäß Artikel 4 des Anhangs der Empfehlung 2003/361/EG** der Kommission für das Jahr zu berechnen, das ein Jahr vor dem Meldestichtag endet.
0150	NACE-Code		Die Risikopositionen sind nach der Wirtschaftstätigkeit der Gegenpartei, die gemäß NACE Rev. 2 laut Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europäischen Parlaments und des Rates*** bestimmt wird, aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) NACE 1: C Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren; b) NACE 2: G Groß- und Einzelhandel; c) NACE 3: F Baugewerbe/Bau; d) NACE 4: H Verkehr und Lagerei; e) NACE 5: D Energieversorgung; f) NACE 6: A Land- und Forstwirtschaft, Fischerei; g) NACE 7: L Grundstücks- und Wohnungswesen; h) NACE 8: Alle Risikopositionen, die nicht unter die vorstehenden Buchstaben a bis g fallen. i) Nicht zutreffend.
0160	Art der Risikoposition	Artikel 147 Absatz 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die Risikopositionen sind entsprechend der Art der Risikoposition aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) Nicht zutreffend; b) Spezialfinanzierungspositionen — Projektfinanzierung; c) Spezialfinanzierungspositionen — Immobilien-Renditeobjekte und hochvolatile Gewerbeimmobilien; d) Spezialfinanzierungspositionen — Objektfinanzierung; e) Spezialfinanzierungspositionen — Rohstoffhandelsfinanzierung; f) Anrechenbare gedeckte Schuldverschreibungen, die die Anforderungen von Artikel 129 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 erfüllen; g) Alle Risikopositionen, die nicht unter die Buchstaben b bis f fallen.
0170	Risikopositions-wert	Meldebogen C 08.01 Spalte 0110 in Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2024/3117 der Kommission und zugehörige Erläuterungen	Die Risikopositionen sind entsprechend dem als Wert der Risikoposition (d. h. Forderungshöhe bei Ausfall („EAD“)) ausgedrückten Risikopositionswert aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) Nicht zutreffend.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0180	Indexierter Beleihungsauslauf		Die Risikopositionen sind entsprechend dem indexierten Beleihungsauslauf (indexed Loan-to-Value, „ILTV“), der das Verhältnis zwischen dem gegenwärtigen Darlehensbetrag und dem Gegenwartswert der Immobilie angibt, aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) Unterklasse 1: $\leq 55 \%$, wenn es sich bei der Immobilie um eine Wohnimmobilie handelt; $\leq 60 \%$, wenn es sich bei der Immobilie um eine Gewerbeimmobilie handelt; b) Unterklasse 2: $> 55 \% \leq 70 \%$, wenn es sich bei der Immobilie um eine Wohnimmobilie handelt; $> 60 \% \leq 70 \%$, wenn es sich bei der Immobilie um eine Gewerbeimmobilie handelt; c) Unterklasse 3: $> 70 \% \leq 80 \%$; d) Unterklasse 4: $> 80 \% \leq 90 \%$; e) Unterklasse 5: $> 90 \% \leq 100 \%$; f) Unterklasse 6: $> 100 \% \leq 110 \%$; g) Unterklasse 7: $> 110 \%$; h) Nicht zutreffend. Der indexierte Beleihungsauslauf ist vorsichtig zu berechnen und muss die folgenden Anforderungen erfüllen: a) Gesamtbetrag des Darlehens: ausstehender Betrag des Hypothekendarlehens zuzüglich des etwaigen nicht in Anspruch genommenen Betrags des Hypothekendarlehens (nach Anwendung des entsprechenden Kreditumrechnungsfaktors). Der Darlehensbetrag ist vor Berücksichtigung etwaiger spezifischer Kreditrisikoanpassungen zu berechnen und umfasst alle weiteren Darlehen (einschließlich dem Institut bekannter Darlehen, die von anderen dem Institut bekannten Finanzinstituten vergeben wurden), die mit gleich- oder höherrangigen Pfandrechten auf dieselbe Wohnimmobilie besichert sind. Liegen zur Ermittlung des Rangs der übrigen Pfandrechte unzureichende Informationen vor, veranschlagt das Institut diese Pfandrechte pari passu zum Pfandrecht, welches das Darlehen besichert. b) Wert der Immobilie: Der Wert der Immobilie entspricht der letzten unabhängigen Bewertung der Immobilie, die auf der Basis eines Immobilienpreisindex in einen Gegenwartswert umgerechnet wird. Die Bewertung ist unabhängig vorzunehmen und von qualifizierten Gutachtern durchzuführen. Die Qualifikationsanforderungen und Mindestbewertungsstandards müssen die folgenden Anforderungen erfüllen: i) Die Immobilie wird individuell bewertet und ihr Wert konservativ und vorsichtig geschätzt (d. h. ohne Einbeziehung für die Zukunft erwarteter Preissteigerungen und unter Berücksichtigung der Möglichkeit, dass der gegenwärtige Preis beispielsweise aufgrund einer Immobilienblase über einem über die Kreditlaufzeit gesehen tragfähigen Niveau liegt); ii) kann ein Marktwert bestimmt werden, geht die Bewertung nicht über den Marktwert hinaus; iii) die Bewertung wird durch hinreichende gutachterliche Unterlagen belegt.
0190	Bilanzieller Ansatz		Die Risikopositionen sind entsprechend dem bilanziellen Ansatz aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) Bilanzielle Posten; b) Außerbilanzielle Posten; c) Sonstige; d) Nicht zutreffend. Risikopositionen, bei denen es sich um Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, Derivate und Geschäfte mit langer Abwicklungsfrist oder produktübergreifende vertragliche Nettingvereinbarungen handelt und bei denen ein Gegenparteiausfallrisiko besteht, werden dem Buchstaben c zugeordnet. Diese Risikopositionen sind weder unter a noch unter b auszuweisen.

C 103.00 — Bestimmung der Portfolios mit hohem Ausfallrisiko

Spalte		Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Portfolio-ID		Eindeutige ID, die jedem Portfolio von der EBA zugewiesen wurde.
0020	Bezeichnung des Portfolios		Jedem Portfolio wird eine der folgenden Portfolio-Bezeichnungen zugewiesen: 1.0 CORP 1.1 CORP, ausgefallen 1.2 CORP, nicht ausgefallen 2.0 SMEC 2.1 SMEC, ausgefallen 2.2 SMEC, nicht ausgefallen 3.0 Sonstiges Mengengeschäft, KMU 3.1 Sonstiges Mengengeschäft, KMU, ausgefallen 3.2 Sonstiges Mengengeschäft, KMU, nicht ausgefallen 4.0 Hypotheken, keine KMU 4.1 Hypotheken, keine KMU, ausgefallen 4.2 Hypotheken, keine KMU, nicht ausgefallen 5.0 Hypotheken, KMU 5.1 Hypotheken, KMU, ausgefallen 5.2 Hypotheken, KMU, nicht ausgefallen 6.0 Sonstiges Mengengeschäft, keine KMU 6.1 Sonstiges Mengengeschäft, keine KMU, ausgefallen 6.2 Sonstiges Mengengeschäft, keine KMU, nicht ausgefallen 7.0 QRRE 7.1 QRRE, ausgefallen 7.2 QRRE, nicht ausgefallen
0030	Art des Risikos		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 101.00 Spalte 0130.
0040	Regelungsansatz		Die Risikopositionen sind entsprechend dem bei der Berechnung der RWEA verwendeten Regelungsansatz aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: a) IRB-Basisansatz; b) Fortgeschrittener IRB-Ansatz.
0050	Geografisches Gebiet		Die Risikopositionen sind entsprechend dem Sitzland (ISO-Code oder ‚Sonstige Länder‘) der Schuldner aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen. Für die Portfolios ‚Mengengeschäft — KMU — durch Immobilien besichert‘ und ‚Mengengeschäft — keine KMU — durch Immobilien besichert‘ sind die Risikopositionen entsprechend dem Standort der Sicherheit aufzuteilen.
0060	Einstufung		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0060.
0070	Risikopositions-klasse		Die Risikopositionen sind entsprechend der Risikopositions-klasse aufzuteilen und Portfolios zuzuordnen: d) Bei Risikopositionen gegenüber Unternehmen in Portfolios mit hohem Ausfallrisiko: d.1) Unternehmen — KMU; d.2) Unternehmen — Keine KMU; e) Bei Risikopositionen aus dem Mengengeschäft:

Spalte		Rechtsgrundlage	Erläuterungen																																
			e.1) Mengengeschäft — KMU; e.1.1) Mengengeschäft — KMU — Durch Immobilien besichert; e.1.2) Mengengeschäft — KMU — Sonstige; e.2) Mengengeschäft — Keine KMU; e.2.1) Mengengeschäft — Keine KMU — Sonstige; e.2.2) Mengengeschäft — Keine KMU — Durch Immobilien besichert; e.3.3) Mengengeschäft — Qualifiziert revolving; f) Nicht zutreffend. Es ist die folgende Zuordnung zwischen den Risikopositionsklassen und der Aufschlüsselung des IRB-Meldebogens für das Kreditrisiko anzuwenden: <table> <tr> <th colspan="2">Risikopositionsklasse</th><th>Portfolio-Code</th><th>*</th></tr> <tr> <td>d.1)</td><td>Unternehmen — KMU</td><td>SMEC</td><td>A.6.2; A.6.3; B.5.2; B.5.3</td></tr> <tr> <td>d.2)</td><td>Unternehmen — Keine KMU</td><td>CORP</td><td>A.6.2; A.6.3; B.5.2; B.5.3</td></tr> <tr> <td>e.1.1)</td><td>Mengengeschäft — KMU — Durch Immobilien besichert</td><td>RSMS</td><td>B.6.5</td></tr> <tr> <td>e.1.2)</td><td>Mengengeschäft — KMU — Sonstige</td><td>SMOT</td><td>B.6.7, B.6.3 **</td></tr> <tr> <td>e.2.1)</td><td>Mengengeschäft — Keine KMU — Sonstige</td><td>RETO</td><td>B.6.8, B.6.3 ***</td></tr> <tr> <td>e.2.2)</td><td>Mengengeschäft — Keine KMU — Durch Immobilien besichert</td><td>MORT</td><td>B.6.6</td></tr> <tr> <td>e.3.3)</td><td>Mengengeschäft — Qualifiziert revolving</td><td>RQRR</td><td>B.6.2</td></tr> </table> * Durchführungsverordnung (EU) 2024/3117 der Kommission vom 29. November 2024 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) 2021/451 der Kommission (ABl. L, 2024/3117, 27.12.2024), Anhang II: Erläuterungen zur Meldung von Eigenmittelanforderungen, Teil II: Erläuterungen zu den einzelnen Meldebögen, Abschnitt 3.3.2. ** Ohne Gegenparteien und deren als keine KMU eingestuftes Risikopositionen. *** Ohne Gegenparteien und deren als KMU eingestuftes Risikopositionen. Die in Artikel 147 Absatz 2 Buchstaben e, ea, f und g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Risikopositionsklassen ‚Beteiligungsrisikopositionen‘, ‚Risikopositionen in Form von Anteilen an einem OGA‘, ‚Posten, die Verbriefungspositionen darstellen‘ und ‚sonstige Aktiva ohne Kreditverpflichtungen‘ werden nicht ausgewiesen.	Risikopositionsklasse		Portfolio-Code	*	d.1)	Unternehmen — KMU	SMEC	A.6.2; A.6.3; B.5.2; B.5.3	d.2)	Unternehmen — Keine KMU	CORP	A.6.2; A.6.3; B.5.2; B.5.3	e.1.1)	Mengengeschäft — KMU — Durch Immobilien besichert	RSMS	B.6.5	e.1.2)	Mengengeschäft — KMU — Sonstige	SMOT	B.6.7, B.6.3 **	e.2.1)	Mengengeschäft — Keine KMU — Sonstige	RETO	B.6.8, B.6.3 ***	e.2.2)	Mengengeschäft — Keine KMU — Durch Immobilien besichert	MORT	B.6.6	e.3.3)	Mengengeschäft — Qualifiziert revolving	RQRR	B.6.2
Risikopositionsklasse		Portfolio-Code	*																																
d.1)	Unternehmen — KMU	SMEC	A.6.2; A.6.3; B.5.2; B.5.3																																
d.2)	Unternehmen — Keine KMU	CORP	A.6.2; A.6.3; B.5.2; B.5.3																																
e.1.1)	Mengengeschäft — KMU — Durch Immobilien besichert	RSMS	B.6.5																																
e.1.2)	Mengengeschäft — KMU — Sonstige	SMOT	B.6.7, B.6.3 **																																
e.2.1)	Mengengeschäft — Keine KMU — Sonstige	RETO	B.6.8, B.6.3 ***																																
e.2.2)	Mengengeschäft — Keine KMU — Durch Immobilien besichert	MORT	B.6.6																																
e.3.3)	Mengengeschäft — Qualifiziert revolving	RQRR	B.6.2																																

Spalte		Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0080	Sektor der Gegenpartei		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0100.
0090	Ausfallstatus		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0090.
0100	Art der Fazilität		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0120.
0110	Besicherungsstatus		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0110.
0120	Art der Sicherheit		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0120.
0130	Gegenpartei		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0130.
0140	Größe der Gegenpartei		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0140.
0150	NACE-Code		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0150.
0160	Art der Risikoposition		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0110.
0170	Risikopositions- wert		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0170.
0180	Indexierter Beleihungsauslauf		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0180.
0190	Bilanzieller Ansatz		Siehe Erläuterungen zu Tabelle C 102.00 Spalte 0190.

Spalte		Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0200	Besicherungsstatus nach IFRS 9	IFRS 9 B.5.55	Die Risikopositionen sind entsprechend ihrem Besicherungsstatus, wie er zwecks Bemessung der erwarteten Kreditverluste nach IFRS 9 zugrunde gelegt wird, Portfolios zuzuordnen. a) Besicherte Risikopositionen Dieses Portfolio muss alle Risikopositionen enthalten, bei denen die Bemessung der erwarteten Kreditverluste nach IFRS 9 B.5.55 die Zahlungsströme aus den zugehörigen Sicherheiten und/oder anderen Bonitätsverbesserungen widerspiegelt, die Bestandteil der Vertragsbedingungen der betreffenden Risikoposition sind und vom Unternehmen nicht gesondert erfasst werden. Risikopositionen, die nur teilbesichert sind, sind in diesem Portfolio in voller Höhe auszuweisen. b) Unbesicherte Risikopositionen. Dieses Portfolio muss alle Risikopositionen enthalten, bei denen die Bemessung der erwarteten Kreditverluste nicht durch die Existenz von Sicherheiten oder Bonitätsverbesserungen anderer Art beeinflusst wird. c) Nicht zutreffend.

C 104.00 — Bestimmung der Portfolios mit hohem Ausfallrisiko für IFRS-9-Meldebögen

Spalte		Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0010	Portfolio-ID		Eindeutige ID, die jedem Portfolio von der EBA zugewiesen wurde.
0020	Bezeichnung des Portfolios		Siehe Erläuterungen zu C 103 Spalte 0020.
0030	Art des Risikos		Siehe Erläuterungen zu C 101 Spalte 0130.
0040	Regelungsansatz		Siehe Erläuterungen zu C 101 Spalte 0140.
0050	Geografisches Gebiet		Siehe Erläuterungen zu C 101 Spalte 0080.
0060	Einstufung		Siehe Erläuterungen zu C 102 Spalte 0060.
0070	Risikopositions-klasse		Siehe Erläuterungen zu C 103 Spalte 0070.
0080	Sektor der Gegenpartei		Siehe Erläuterungen zu C 101 Spalte 0100.
0090	Ausfallstatus		Siehe Erläuterungen zu C 102 Spalte 0090.

Spalte		Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0100	Art der Fazilität		Siehe Erläuterungen zu C 101 Spalte 0120.
0110	Besicherungsstatus		Siehe Erläuterungen zu C 102 Spalte 0110.
0120	Art der Sicherheit		Siehe Erläuterungen zu C 102 Spalte 0120.
0130	Gegenpartei		Siehe Erläuterungen zu C 102 Spalte 0130.
0140	Größe der Gegenpartei		Siehe Erläuterungen zu C 102 Spalte 0140.
0150	NACE-Code		Siehe Erläuterungen zu C 102 Spalte 0150.
0160	Art der Risikoposition		Siehe Erläuterungen zu C 101 Spalte 0110.
0170	Risikopositions- wert		Siehe Erläuterungen zu C 102 Spalte 0170.
0180	Indexierter Beleihungsauslauf		Siehe Erläuterungen zu C 102 Spalte 0180.
0190	Bilanzieller Ansatz		Siehe Erläuterungen zu C 102 Spalte 0190.
0200	Besicherungsstatus nach IFRS 9	IFRS 9 B.5.55	Siehe Erläuterungen zu C 103 Spalte 0200.“

ANHANG II

„ANHANG V

REFERENZINSTRUMENTE UND -PORTFOLIOS ‚MARKTRISIKO‘

Abschnitt 1: Erläuterungen	18
Abschnitt 2: Instrumente	22
Abschnitt 3: Einzelne Portfolios — Einzelnes Instrument	36
Abschnitt 4: Einzelne Portfolios — Mehrere Instrumente	39
Abschnitt 5: Aggregierte Portfolios	42
Abschnitt 6: Instrumente — zusätzliche Spezifikationen	43
Abschnitt 7: SBM-Validierungsportfolios	45

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‘) für Banken mit genehmigten internen Modellen (IMA): Wert von VaR, sVaR und, falls erforderlich, IRC und APR für die Portfolios, gemäß den Abschnitten 3 bis 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 19. Februar 2026;
 - ii) IMV- (und erstes SBM-)Referenzdatum ist der 27. Februar 2026 (17:30 Uhr MEZ);
 - iii) IMV- (und erster SBM- und SBM-Validierungs-)Einreichungstermin ist der 13. März 2026;
 - iv) erstes RM-Referenzdatum ist der 18. Mai 2026;
 - v) letztes RM- (und letztes ASA-)Referenzdatum ist der 29. Mai 2026;
 - vi) RM- (und letzter ASA-)Einreichungstermin ist der 26. Juni 2026.
- 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) verfügbare Referenzdaten für das Instrument im institutseigenen Format;
 - iv) die unter den Buchstaben h, i, l, n, o, p, w, x, z und hh dieses Abschnitts genannten Aspekte;
 - v) Institute, die interne Modelle verwenden dürfen, müssen außerdem Folgendes melden:
 - 1. die in das interne Modell für das Instrument eingehenden Risikofaktoren;
 - 2. die in das interne Modell eingehenden Risikofaktoren, die als Bewertungsfaktoren auch in die IMV des Instruments eingehen;
 - 3. Spezifika des internen Modells in Bezug auf die Instrumente.
- f) Für die Zwecke von Buchstabe e Ziffer v ist alles Folgende anzugeben:
 - i) Kurzbeschreibung des internen 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. Erlöschten 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 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 Erläuterungen an.
- aa) Die Risikomessgrößen für die in den Abschnitten 3 bis 5 dieses Anhangs 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 dieses Anhangs genannten Portfolios melden die Institute die SBM-Ergebnisse und übermitteln sie gemäß den Meldestichtagen für die IMV-Meldung.
- cc) Institute, die in den Anwendungsbereich des Benchmarkings fallen, melden ausschließlich Instrumente nach internen Modellen, die durch die Aufsichtsbehörden genehmigt wurden, und deren Handel nicht durch interne Richtlinien oder Einschränkungen des Handelssystems untersagt ist.
- dd) Die Ergebnisse für die einzelnen und die aggregierten Portfolios sind nur dann zu übermitteln, wenn die Ergebnisse für alle darin enthaltenen Instrumente ebenfalls übermittelt werden.
- ee) In Abschnitt 2 dieses Anhangs (Instrumente) bezeichnet das ‚Jahr T‘, 2026‘ und ‚Jahr T + X‘, 2026 + X‘, wobei X im Sinne von Abschnitt 2 zu verstehen ist.
- ff) In Abschnitt 2 dieses Anhangs (Instrumente) haben die Institute den Verfalltag/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 Verfalltag/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 e 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: September 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: September Jahr T
EBA-Instrument-Währung: EUR
- 104. Shortposition Futures, STELLANTIS (Ticker: STLA FP)

Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts
Börse: Euronext
Verfallstag: September Jahr T
EBA-Instrument-Währung: EUR

105. Shortposition Futures, ALLIANZ (Ticker: ALV GR)
Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts
Börse: Eurex
Verfallstag: September Jahr T
EBA-Instrument-Währung: EUR
106. Shortposition Futures, BARCLAYS (Ticker: BARC LN)
Nominalbetrag: Gegenwert von 10 000 Anteilen des Basiswerts
Börse: Eurex
Verfallstag: September 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: September 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: September 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: September 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: September 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: September 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: September 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: September Jahr T
 EBA-Instrument-Währung: JPY
118. Aktienprodukt, Auto-Callable
 Longposition
 Buchung zum ‚Buchungszeitpunkt‘
 Nominalbetrag (‚Kapitalbetrag‘): 1 000 000 EUR
 Basiswert: EURO-STOXX-50-Index (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 $SX5E \geq 60\%$ (Barriere Kupon) des ursprünglichen Werts zum Ende eines Jahres, wird ein Kupon von 6 % ausbezahlt.

- Falls $SX5E \geq 100\%$ 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 $SX5E \geq 55\%$ (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: September 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: September Jahr T

EBA-Instrument-Währung: EUR

121. Longposition Futures, VIX-Index (CBOE)

Nominalbetrag: Gegenwert von Indexwert mal 100 000 USD

Verfallstag: September 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: Buchungsdatum + 5 Jahre

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 (Overnight-SOFR, täglich aufgezinzt), zahle vierteljährlich

Nominalbetrag: 1 000 000 USD

Roll-Konvention und Kalender: Standard

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

Fälligkeitstermin: Buchungsdatum + 5 Jahre

EBA-Instrument-Währung: USD

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

Festsatz: erhalte jährlich

Variabler Zinssatz: SONIA-(Tagesgeld-)Satz, aufgezinzt 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 (Overnight-SOFR, täglich aufgezinzt) 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: a) 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, aufgezinnt mit einer Zahlungsverzögerung von 2 Tagen
Zinsberechnung: ACT/360
USD: 3-Monats-SOFR (Overnight-SOFR, täglich aufgezinnt), erhalte vierteljährlich, aufgezinnt 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: Buchungsdatum + 10 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): $[(1 + r)^5 - 1]$
- Erhalte inflationsindexierte Rendite: $\left[\left(\frac{VPI \text{ am Fälligkeitstermin}}{VPI \text{ am Starttag}} \right) - 1 \right]$
- Nominalbetrag: 10 000 000 EUR
- Basisfixingtermin: Buchungsdatum — 3 Monate
- Endgültiges Fixing: Buchungsdatum + 4 Jahre 9 Monate
- Fälligkeit: Buchungsdatum + 5 Jahre
- 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

Ausübungspreis des Forwards: entspricht 100 % des entsprechenden EUR/DKK-EZB-Referenzkassakurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

EBA-Instrument-Währung: EUR

311. 6-Monats-EUR/BRL Nicht lieferbarer Forward-Vertrag (EUR Long, BRL Short). Nominalbetrag 10 000 000 EUR

Ausübungspreis des Forwards: entspricht 100 % des entsprechenden EUR/BRL-EZB-Referenzkassakurses bei Tagesschluss am Buchungsdatum

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 (Brent Crude Oil Long, USD Short). Cash-settled. Ausübungspreis: 12-Monats-Forward-Kurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum. Verfalltag: Buchungsdatum + 6 Monate

EBA-Instrument-Währung USD

404. Short-Put-Option 30 000 Barrel Rohöl Brent (Brent Crude Oil Long, USD Short). Cash-settled. Ausübungspreis: 12-Monats-Forward-Kurs bei Tagesschluss am Buchungsdatum. Verfalltag: 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. Verfalltag: 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
Verfalltag: 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

In das alternative Korrelationshandelsportfolio einbezogene Instrumente

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	<i>Kombination aus Instrumenten</i> 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	IMA-Risikomessgrößen (VaR, SVaR und gegebenenfalls IRC und APR) erforderlich	ASA-Risikomessgrößen nach FRTB (SBM, DRC, RRAO) erforderlich
1001	101-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1002	102-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1003	103-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1004	104-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1005	105-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1006	106-1 Instrument	GBP	Nein	Ja
1007	107-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1008	108-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1009	109-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1010	110-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1011	111-1 Instrument	USD	Nein	Ja
1012	112-1 Instrument	USD	Nein	Ja
1013	113-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1014	114-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1015	115-1 Instrument	GBP	Nein	Ja
1016	116-1 Instrument	GBP	Nein	Ja
1017	117-1 Instrument	JPY	Nein	Ja
1018	118-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1019	119-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1020	120-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1021	121-1 Instrument	USD	Nein	Ja
2001	201-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2002	202-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2003	203-1 Instrument	USD	Nein	Ja
2004	204-1 Instrument	GBP	Nein	Ja
2005	205-1 Instrument	USD	Nein	Ja
2006	206-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2007	207-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2008	208-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2009	209-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2010	210-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2011	211-1 Instrument	EUR	Nein	Ja

Portfolio	<i>Kombination aus Instrumenten</i> 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	IMA-Risikomessgrößen (VaR, SVaR und gegebenenfalls IRC und APR) erforderlich	ASA-Risikomessgrößen nach FRTB (SBM, DRC, RRAO) erforderlich
2012	212-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2013	213-1 Instrument	GBP	Nein	Ja
2014	214-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2015	215-1 Instrument	USD	Nein	Ja
2016	216-1 Instrument	USD	Nein	Ja
2017	217-1 Instrument	USD	Nein	Ja
2018	218-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2019	219-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2020	220-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2021	221-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2022	222-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2023	223-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2024	224-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3001	301-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3002	302-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3003	303-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3004	304-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3005	305-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3006	306-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3007	307-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3008	308-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3009	309-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3010	310-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3011	311-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
4001	401-1 Instrument	USD	Nein	Ja
4002	402-1 Instrument	USD	Nein	Ja
4003	403-1 Instrument	USD	Nein	Ja
4004	404-1 Instrument	USD	Nein	Ja
4005	405-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5001	501-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5002	502-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5003	503-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5004	504-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5005	505-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5006	506-1 Instrument	USD	Nein	Ja

Portfolio	<i>Kombination aus Instrumenten</i> 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	IMA-Risikomessgrößen (VaR, SVaR und gegebenenfalls IRC und APR) erforderlich	ASA-Risikomessgrößen nach FRTB (SBM, DRC, RRAO) erforderlich
5007	507-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5008	508-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5009	509-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5010	510-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5011	511-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5012	512-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5013	513-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5014	514-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5015	515-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5016	516-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5017	517-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5018	518-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5019	519-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5020	520-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5021	521-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5022	522-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5023	523-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5024	524-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5025	525-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5026	526-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5027	527-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5028	528-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5029	529-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5030	530-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5031	531-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5032	532-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5033	533-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5034	534-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6001	601-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6002	602-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6003	603-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6004	604-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6005	605-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6006	606-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6007	607-1 Instrument	EUR	Nein	Ja

Portfolio	<i>Kombination aus Instrumenten</i> 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	IMA-Risikomessgrößen (VaR, SVaR und gegebenenfalls IRC und APR) erforderlich	ASA-Risikomessgrößen nach FRTB (SBM, DRC, RRAO) erforderlich
6008	608-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6009	609-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6010	610-1 Instrument	EUR	Nein	Ja

Abschnitt 4: Einzelne Portfolios — Mehrere Instrumente

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

Portfolio	<i>Kombination aus Instrumenten</i> 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	IMA-Risikomessgrößen (VaR, SVaR und gegebenenfalls IRC und APR) erforderlich	ASA-Risikomessgrößen nach FRTB erforderlich
1101	103-1 Instrument 104-1 Instrument 105-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1102	113-1 Instrument 110-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1103	115-1 Instrument 116-1 Instrument	GBP	Nein	Ja
1104	109-1 Instrument 110-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1105	111-1 Instrument 112-1 Instrument	USD	Nein	Ja
1106	102-1 Instrument 114-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1107	106-1 Instrument 107-1 Instrument 108-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1108	101-1 Instrument 103-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1109	101-1 Instrument 103-1 Instrument 104-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
1110	102-1 Instrument 104-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2201	206-1 Instrument 207-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2202	206-1 Instrument 207-1 Instrument 208-1 Instrument	EUR	Nein	Ja

Portfolio	<i>Kombination aus Instrumenten</i> 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	IMA-Risikomessgrößen (VaR, SVaR und gegebenenfalls IRC und APR) erforderlich	ASA-Risikomessgrößen nach FRTB erforderlich
2203	206-1 Instrument 207-1 Instrument 208-1 Instrument 209-1 Instrument 210-1 Instrument 211-1 Instrument 212-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2204	201-1 Instrument 218-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2205	201-1 Instrument 219-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2206	218-1 Instrument 219-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2207	201-1 Instrument 202-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2208	215-1 Instrument 216-1 Instrument 217-1 Instrument	USD	Nein	Ja
2209	203-1 Instrument 215-1 Instrument	USD	Nein	Ja
2210	208-1 Instrument 209-1 Instrument 210-1 Instrument 214-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2211	209-1 Instrument 219-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
2212	201-1 Instrument 223-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3301	301-1 Instrument 302-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3302	303-1 Instrument 304-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3303	304-1 Instrument 305-1 Instrument 306-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
3304	307-1 Instrument 308-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
4401	401-1 Instrument 402-1 Instrument	USD	Nein	Ja
4402	403-1 Instrument 404-1 Instrument	USD	Nein	Ja
4403	401-1 Instrument 404-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5501	501-1 Instrument 502-1 Instrument 503-1 Instrument	USD	Nein	Ja

Portfolio	<i>Kombination aus Instrumenten</i> 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	IMA-Risikomessgrößen (VaR, SVaR und gegebenenfalls IRC und APR) erforderlich	ASA-Risikomessgrößen nach FRTB erforderlich
5502	504-1 Instrument 505-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5503	507-1 Instrument 508-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5504	503-1 Instrument 504-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5505	509-1 Instrument 510-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5506	511-1 Instrument 512-1 Instrument 514-1 Instrument 515-1 Instrument 516-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5507	517-1 Instrument 518-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5508	519-1 Instrument 520-1 Instrument 522-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5509	520-1 Instrument 521-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5510	519-1 Instrument 508-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5511	515-1 Instrument 522-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5512	520-1 Instrument 521-1 Instrument 516-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5513	506-1 Instrument 503-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5514	502-1 Instrument 209-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5515	504-1 Instrument 217-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5516	505-1 Instrument 216-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5517	504-1 Instrument 217-1 Instrument 505-1 Instrument 216-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5518	502-1 Instrument 209-1 Instrument 219-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5519	523-1 Instrument 525-1 Instrument 527-1 Instrument	EUR	Nein	Ja

Portfolio	<i>Kombination aus Instrumenten</i> 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	IMA-Risikomessgrößen (VaR, SVaR und gegebenenfalls IRC und APR) erforderlich	ASA-Risikomessgrößen nach FRTB erforderlich
5520	524-1 Instrument 526-1 Instrument 528-1 Instrument	USD	Nein	Ja
5521	523-1 Instrument 524-1 Instrument 525-1 Instrument 526-1 Instrument 527-1 Instrument 528-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
5522	529-1 Instrument 530-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6601	601-1 Instrument 602-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6602	603-1 Instrument 604-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6603	605-1 Instrument 606-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6604	607-1 Instrument 608-1 Instrument	EUR	Nein	Ja
6605	609-1 Instrument 610-1 Instrument	EUR	Nein	Ja

Abschnitt 5: Aggregierte Portfolios

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

Aggreg. Portfolio	Beschreibung	<i>Kombination einzelner Portfolios (einzelne Nummernangabe in Abschnitt 3 und 4 dieses Anhangs)</i>	EBA-Portfolio-Währung	IMA-Risikomessgrößen (VaR, SVaR und gegebenenfalls IRC und APR) erforderlich	ASA-Risikomessgrößen nach FRTB erforderlich
10000	Gesamtportfolio Nicht-CTP	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	Nein	Ja
11000	AKTIEN kumulativ	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	Nein	Ja
12000	IR kumulativ	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	Nein	Ja
13000	FX kumulativ	3301, 3303, 3304	EUR	Nein	Ja

Aggreg. Portfolio	Beschreibung	Kombination einzelner Portfolios (einzelne Portfolios laut Nummernangabe in Abschnitt 3 und 4 dieses Anhangs)	EBA-Portfolio-Währung	IMA-Risikomessgrößen (VaR, SVaR und gegebenenfalls IRC und APR) erforderlich	ASA-Risikomessgrößen nach FRTB erforderlich
14000	Warenposition kumulativ	4401, 4402	USD	Nein	Ja
15000	Kreditspread kumulativ	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	Nein	Ja
16000	CTP kumulativ in EUR	6601, 6602	EUR	Nein	Ja

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 (Overnight-SOFR, täglich aufgezinst) + 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
<i>Variable Seite 2</i>	
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 ausschließlich Meldebogen C 106.02.
 - 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. Bezieht sich ein Instrument, das Teil eines in Anhang X genannten Validierungsportfolios ist, auf Krümmungsrisiken, sollten die Banken sowohl die Aufwärts- als auch die Abwärts-Krümmungsrisikopositionen berücksichtigen, die unter derselben Instrumentennummer, aber in getrennten Zeilen innerhalb der in Anhang X genannten Instrumente angegeben werden.“
-

ANHANG III

„ANHANG VI

ERGEBNISSE DER AUFSICHTLICHEN REFERENZPORTFOLIOS

MELDEBOGENSPEZIFISCHE ERLÄUTERUNGEN

C 106.00 — Ursprüngliche Marktbewertung und Gründe für die Nichteinbeziehung	47
C 106.01 — SBM. Risikosensitivitäten nach Instrument	47
C 106.02 — SBM. OFR-Zusammensetzung nach SBM-Validierungsportfolios	52
C 107.01 — VaR und sVaR Nicht-CTP. Nähere Angaben	53
C 107.02 — VaR, sVaR und PV — Nicht-CTP. Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung	56
C 108.00 — Gewinn- und Verlust-Zeitreihen	57
C 109.01 — IRC. Nähere Angaben zum Modell	57
C 109.02 — IRC. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios	58
C 109.03 — IRC. Betrag nach Portfolio/Datum	59
C 110.01 — CT. Nähere Angaben zum Modell	60
C 110.02 — CT. Nähere Angaben zu den einzelnen Portfolios	60
C 110.03 — CT. APR nach Portfolio/Datum	61
C 120.01 — SBM. RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO	62
C 120.02 — SBM. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO	66
C 120.04 — DRC. MARKTWERTE UND JTD-BRUTTOBETRÄGE NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO	68
C 120.05 — DRC. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO	74
C 120.06 — ASA. OFR	77

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 (Währungscode nach ISO 4217, z. B. ‚EUR_USD‘).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
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 die Rechtsträgerkennung (LEI) des Emittenten anzugeben, die für zwei gemeldete Sensitivitäten gegenüber zwei Risikofaktoren, für 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 ISIN des zugrunde liegenden Instruments 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.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			— 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‘).
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).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
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.
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 106.02 — SBM. OFR-Zusammensetzung nach SBM-Validierungsportfolios

Erläuterungen zu den Datenblättern (z-Achse)

Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
Portfolio	Anhang V Abschnitt 7	Angabe der Nummer des Portfolios aus Anhang X.

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	Korrelationsszenario	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	Eigenmittelanforderungen (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 für das „IMV-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.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0050	Übermittlung der Ergebnisse für die SBM-Validierungsportfolios	Artikel 325e Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Auszuwählen ist eine der folgenden Antworten: 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.
0060	Freitextfeld		In dieser Spalte kann das Institut zusätzliche Angaben machen.

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 Beobachtungszeitraums	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-Zuschlagsfaktor	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.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
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). 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 sVaR-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 sVaR-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.
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). 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.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
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.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
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.

Zeile	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
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.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
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.
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‘).

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			— 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 die Rechtsträgerkennung (LEI) des Emittenten anzugeben, die für zwei gemeldete Sensitivitäten gegenüber zwei Risikofaktoren, für die nach Artikel 325ai Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ein Korrelationsparameter $\rho_{k(name)}$ 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.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			— Aktienkursrisiko, so ist die ISIN des zugrunde liegenden Instruments 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.
0060	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 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 für alternative Berechnungen der Delta-Risikosensitivitäten nach Artikel 325t Absatz 5 der genannten Verordnung erhalten, so beziehen sie sich bei ihrer Meldung auf diese alternativen Definitionen. — 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.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0070	Währung der Rechnungslegung		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.
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	Korrelationsszenario	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	Eigenmittelanforderungen (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.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
0050	Währung der Rechnungslegung		Hier ist die Währung der Rechnungslegung des Instituts anzugeben (Währungscode nach ISO 4217).
0060	Eigenmittelanforderungen (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 Eigenmittelanforderungen 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.
0080	Basiswährungsansatz für Delta-Faktor- und Krümmungsrisikofaktoren des Fremdwährungsrisikos	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 Krümmungsrisikokomponenten für das Fremdwährungsrisiko 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.
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 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‘;

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			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’;

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			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 die LEI 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)“; 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“;

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			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	Ausfallrisikogewicht	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) ‚Gedekte 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.
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.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
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 Tranchierungspunkt (%)	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 Tranchierungspunkt (%)	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 $P\&L_{\text{long}}$ und $\text{Adjustment}_{\text{long}}$ an.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			— 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 $P\&L_{\text{short}}$ und $\text{Adjustment}_{\text{short}}$ an. 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 $P\&L_{\text{long}}$ und $\text{Adjustment}_{\text{long}}$ an.

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			— 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. 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-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 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‘;

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			c) „Gebietskörperschaften/Kommunen“. 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“;

Spalte	Bezeichnung	Rechtsgrundlage	Erläuterungen
			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 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	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	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	Eigenmittelanforderungen (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	
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
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
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
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Abwärtsverschiebung	CSR_SEC_ACTP_CD	Artikel 325n und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 Jahr	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 Jahre	Schuldtitel	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_DEBT	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 Jahr	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 Jahre	Kreditausfallswap	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	0,5 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	1 Jahr		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	3 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	5 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	10 Jahre		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Artikel 325n der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVATURE		Aufwärtsverschiebung	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Artikel 325n und 325g der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
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_00EQ_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
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
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
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
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“

Ergebnisse der aufsichtlichen Referenzportfolios. MARKTRISIKO

ERGEBNISSE REFERENZPORTFOLIOS. MARKTRISIKO			
Meldebogennummer	Meldebogencode	Bezeichnung des Meldebogens/der Meldebogengruppe	Kurzbezeichnung
		URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG	
106	C 106.00	URSPRÜNGLICHE MARKTBEWERTUNG UND GRÜNDE FÜR DIE NICHT EINBEZIEHUNG	IMV
106.01	C 106.01	RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT	SENSITIVITÄTEN
106.02	C 106.02	SBM. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH SBM-VALIDIERUNGSPORTFOLIOS	SBM-Validierung
		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)	
120.01	C 120.01	SBM. RISIKOSENSITIVITÄTEN NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO	SBM 1
120.02	C 120.02	SBM. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO	SBM 2
120.04	C 120.04	DRC. MARKTWERTE UND JTD-BRUTTOBETRÄGE NACH INSTRUMENT/PORTFOLIO	DRC 1
120.05	C 120.05	DRC. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH PORTFOLIO	DRC 2
120.06	C 120.06	ASA. OFR NACH PORTFOLIO	ASA OFR

DE

Abl. L vom 12.8.2026

Nummer des Instruments

--

[illegible]

C 106.02 — SBM. OFR-ZUSAMMENSETZUNG NACH SBM-VALIDIERUNGSPORTFOLIOS

Portfolio

Risikoklasse	Risikokomponente	Korrelationsszenario	Eigenmittelanforderungen (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Übermittlung der Ergebnisse für die SBM- Validierungsportfolios	Freitextfeld
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 107.01 — VaR, sVaR und PV. NÄHERE ANGABEN

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

C 108.00 — GEWINN- UND VERLUST-ZEITREIHEN

Portfolio

Datum	Tägliche GuV
0010	0020

C 109.01 — IRC. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	0010	0020
0010	Anzahl der Modellierungsfaktoren		
0020	Herkunft der LGDs		

C 109.02 — IRC. NÄHERE ANGABEN ZU DEN EINZELNEN PORTFOLIOS

Portfolio

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	0010	0020
0010	Liquiditätshorizont		
0020	Herkunft der PDs		
0030	Herkunft der Übergangsmatrizen		

C 109.03 — IRC. BETRAG PRO PORTFOLIO/DATUM

Portfolio

Datum	IRC
0010	0020

C 110.01 — CT. NÄHERE ANGABEN ZUM MODELL

		Option	Freitextfeld
Zeile	Posten	0010	0020
0010	Anzahl der Modellierungsfaktoren		
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 Übergangsmatrizen		

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

Risiko-klasse	Risikokompo-nente	Korrelationsszena-rio	Eigenmittelanforderun-gen (Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung)	Währung der Rechnungsle-gung	Eigenmittelanforderun-gen (Ergebnisse in der EBA-Portfolio-Währung)	Positionen ohne Optionalität, die Eigenmittelanforderun-gen in Bezug auf das Krümmungsrisiko unterliegen	Basiswährungs-ansatz für Delta-Faktor- und Krümmungsrisi-kofaktoren des Fremdwährungs-risikos	Division der Krümmungsrisiko-komponenten für das Fremdwährungsri-siko durch Skalare	Freitext-feld
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100

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

Portfolio

Integer

Nummer des Instru- ments	Risiko- klasse	Unter- klasse 1	Unter- klasse 2	Schuld- ner	Bonitäts- kategorie	Ausfall risikoge- wicht	Rang	Laufzeit	Erlös- quote	Richtung	Unterer Tranchie- rungspunkt (%)	Oberer Tranchie- rungspunkt (%)	Ergebnisse in der Währung der Rechnungslegung				Ergebnisse in der EBA-Portfolio- Währung		
													Nominal- betrag	GuV + Anpassung (P&L + Adjustment)	JTD- Brutto- betrag	Währung	Nominal- betrag	GuV + Anpassung (P&L + Adjustment)	JTD- Bruttobe- trag
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“

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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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	FLÜSSIGERD GAS (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
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
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	FLÜSSIGERD GAS (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
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
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

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	FLÜSSIGERDAS (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
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#

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#
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_b1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_e1#
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_b1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# 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#
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#
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#
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#
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#
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_a2# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# 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# 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_a2# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# 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_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#
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_b1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_f1#
F023	FX	ALL	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# 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_b1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# 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#
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#
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#
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#
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#
N103	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# 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_a2# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1#

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#
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#
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#
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_a2# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# 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_a2# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_z1#“
------	----	-----	--