

30. Marktrisikomeldung Währungsgesamtposition

MKR FW

Stand Ende: _____

Ort: _____

Institutsnummer: _____ Prüzfiffer: _____

Name: _____

- in Tsd Euro -

Positionen		Insgesamt (Spalte 02 bis 07)							
		01	02	03	04	05	06	07	08
Aktivpositionen									
1. Bilanzielle Vermögensgegenstände einschl. zeitanteiliger Erträge	010								
2. Liefer- und Zahlungsansprüche aus Kassageschäften	020								
sonstigen Derivaten ohne Optionsrechte der Positionen 3 und 4	030								
Ansprüche auf Zahlung von Kapitalbeträgen aus Finanz-Swaps	040								
3. Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zustehende Liefer- oder Zahlungsansprüche aus Devisen- oder Goldoptionen	050								
4. Sonstige eigene Optionsrechte	060								
5. Sonstige Aktivpositionen	070								
Aktivpositionen insgesamt	100								
Passivpositionen									
1. Bilanzielle Schulden einschließlich zeitanteiliger Aufwendungen	110								
2. Liefer- und Zahlungsverpflichtungen aus Kassageschäften	120								
sonstigen Derivaten ohne Optionsrechte der Positionen 3 und 4	130								
Verpflichtungen zur Zahlung von Kapitalbeträgen aus Finanz-Swaps	140								
3. Als Optionsberechtigter/Stillhalter zu erfüllende Liefer- oder Zahlungsverpfl. aus Devisen- oder Goldoptionen	150								
4. Sonstige fremde Optionsrechte	160								
5. Sonstige Passivpositionen	170								
Passivpositionen insgesamt	200								
Offene	210	+	+	+	+	+	+	+	+
Einzelwährungsposition	220	./.	./	./.	./.	./.	./.	./.	./.
Nettowährungsposition (der größere Betrag - ohne Vorzeichen - der Zeilen 210/01 oder 220/01)	230								
abzüglich 50 % der ausgeglichenen Währungsposition in eng verbundenen Währungen	240	./.							
zuzüglich offene Goldposition (Betrag der Zeile 230 /08)	250	+							
zuzüglich des Anrechnungsbetrages für Investmentanteile nach § 294 Abs. 6 Satz 6 SolvV	255	+							
Nettoabgrenzungsbetrag für zeitant. Erträge/Aufwendungen (nur für Institute, bei denen die Abgrenzung nicht pro Fremdwährung verfügbar ist)	260	+							
Währungsgesamtposition (Summe der Zeilen 230 bis 260)	270								

Offene Goldposition

x 8,0 %

99001

Anrechnungsbetrag für Währungsgesamtposition

Nachrichtlich:

Strukturelle Währungspositionen nach § 4 Abs. 4 SolvV	99002
Abzugsposten in Fremdwährung nach § 4 Abs. 4 SolvV	99003