

31. Marktrisikomeldung Rohwarenposition

MKR RW

Stand Ende:

Institutsnummer: _____ Prüfziffer _____ Name: _____ Ort: _____

- in Tsd Euro -

Positionen		Insgesamt	Öle, Petroleum und Gas	Landwirtschaftl. Erzeugnisse	Metalle	Übrige Rohwaren
		01	02	03	04	05
Aktivpositionen						
1. Unter Aktiva der Bilanz auszuweisende Rohwarenbestände	010					
2. Lieferansprüche aus						
Kassageschäften	020					
Termingeschäften	030					
Swappeschäften	040					
3. Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zustehende Lieferansprüche	050					
4. Eventualanprüche auf Rückgabe von in Pension gegebenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	060					
Aktivpositionen insgesamt	100					
Passivpositionen						
1. Lieferverpflichtungen aus						
Kassageschäften	110					
Termingeschäften	120					
Swappeschäften	130					
2. Als Optionsberechtigter/Stillhalter zu erfüllende Lieferverpflichtungen	140					
3. Eventualverbindlichkeiten auf Rückgabe von in Pension genommenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	150					
Passivpositionen insgesamt	200					

I. Vereinfachtes Verfahren

		01	02	03
Summe der Aktiv- und Passivpositionen	210		x 3,0 %	
Summe der offenen Rohwareneinzelpositionen	220		x 15,0 %	
	230		Summe A	

II. Zeitfächermethode

		01	02	03
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen nach § 297 Abs. 2 Satz 3 SolvV	300		x 0 %	
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen vor und nach der Verrechnung zwischen den Zeitfächern	310		x 3,0 %	
Summe der offenen Bereichspositionen nach Verrechnung	320		x 0,6 %	
Verbleibende offene Bereichsposition	330		x 15,0 %	
	340		Summe B	
	350	Anrechnungsbetrag für Rohwarenposition (Zeile 230+340)		