

65. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

MKR QZK

Übergeordnetes Unternehmen: _____
 Institutsnummer: _____ Prüzfiffer: _____ Instituts-/Finanzholding-Gruppe: _____

Stand Ende: _____ Blatt 2
 Ort: _____

Allgemeines Kursrisiko Zinsnettoposition

- in Mio Euro -

| Nominalverzinsung < 3 % bzw. gemäß Duration | | | Langfristige Laufzeitzone | | | | | | | |
|--|----------------------------|-----|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|---------------------|
| | | | über 3,6 bis zu 4,3 Jahren | über 4,3 bis zu 5,7 Jahren | über 5,7 bis zu 7,3 Jahren | über 7,3 bis zu 9,3 Jahren | über 9,3 bis zu 10,6 Jahren | über 10,6 bis zu 12,0 Jahren | über 12,0 bis zu 20,0 Jahren | über 20,0 Jahren |
| Nominalverzinsung ≥ 3 % | | | über 4 bis zu 5 Jahren | über 5 bis zu 7 Jahren | über 7 bis zu 10 Jahren | über 10 bis zu 15 Jahren | über 15 bis zu 20 Jahren | über 20 Jahren | | |
| | | | 09 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 |
| I. Jahresbandmethode Zinsnettoposition | Aktivische Ausrichtung | 110 | | | | | | | | |
| | Passivische Ausrichtung | 120 | | | | | | | | |
| darunter: in Euro | Aktivische Ausrichtung | 130 | | | | | | | | |
| | Passivische Ausrichtung | 140 | | | | | | | | |
| darunter: in US-\$ | Aktivische Ausrichtung | 150 | | | | | | | | |
| | Passivische Ausrichtung | 160 | | | | | | | | |
| II. Durationsmethode: Zinsnettoposition | Aktivische Ausrichtung | 170 | | | | | | | | |
| | Passivische Ausrichtung | 180 | | | | | | | | |
| gewichtete Zinsnettoposition | Aktivische Ausrichtung | 190 | | | | | | | | |
| | Passivische Ausrichtung | 200 | | | | | | | | |
| darunter: gewichtete Zinsnettoposition in Euro | Aktivische Ausrichtung | 210 | | | | | | | | |
| | Passivische Ausrichtung | 220 | | | | | | | | |
| darunter: gewichtete Zinsnettoposition in US-\$ | Aktivische Ausrichtung | 230 | | | | | | | | |
| | Passivische Ausrichtung | 240 | | | | | | | | |

65. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

MKR QZK

Übergeordnetes Unternehmen: _____

Stand Ende: _____ Blatt 3

Institutsnummer: _____ Prüfziffer: ____ Instituts-/Finanzholding-Gruppe: _____

Ort: _____

Besonderes Kursrisiko Zinsnettoposition

- in Mio Euro -

| Positionen | | Zinsnettoposition | Gewichtungssätze | risikogewichtete Zinsnettoposition | Gewichtung nach § 303 Abs. 1 | Anrechnungsbeträge |
|--|-----|-------------------|------------------|------------------------------------|--|--------------------|
| | | 01 | 02 | 03 | 04 | 05 |
| Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 2 | 310 | | x 0,0 % | | X 8 % | |
| Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 3 Restlaufzeit bis 6 Monate | 320 | | x 3,125 % | | | |
| Restlaufzeit über 6 Monate bis zu 2 Jahren | 330 | | x 12,5 % | | | |
| Restlaufzeit von mehr als 2 Jahren | 340 | | x 20,0 % | | | |
| Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 1 | 350 | | x 100,0 % | | | |
| Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 4 | 360 | | x 150,0 % | | | |
| Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 5 | 370 | | | | | |
| Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 6 | 380 | | | | | |
| Summe Zinsnettopositionen | 400 | | | | Summe | |
| | | 410 | | | Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV | |
| | | 420 | | | Teilanrechnungsbetrag für das besondere Kursrisiko | |

Pauschalierter Anrechnungsbetrag für Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 1 und 2 SolvV

| Positionen | | Maßgeblicher Betrag | Gewichtungssätze | Anrechnungsbeträge |
|--|-----|---------------------|------------------|--------------------|
| | | 01 | 02 | 03 |
| Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 1 | 500 | | X 32% | |
| Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 2 | 510 | | X 40 % | |
| Summe | 520 | | | |