

Laufzeitbandtabelle als Beispiel zur Bestimmung der Eigenmittelanforderungen:

Zone	Laufzeitband	Gewichtung	Positionen					Eigenmittelanforderungen				
			offen			geschlossen		Nettopos.	vertik. Aufrechnung	horizontale Aufrechnung		
			long	short (-)	netto	ungewichtet	gewichtet	offen, gew.	laufzeitbandintern	zonenintern	Nachbarzonen	Nicht-Nachbarz.
1	< 1 Mt.	0.00%	200	-100	100	100	0.00	0.00	0.0000	0.08	0.48	
	1 - 3 Mt.	0.20%	300	-200	100	200	0.40	0.20	0.0400			
	3 - 6 Mt.	0.40%	100	-100	0	100	0.40	0.00	0.0400			
	6 - 12 Mt.	0.70%	200	-400	-200	200	1.40	-1.40	0.1400			
2	1.0 - 1.9 y	1.25%	400	-100	300	100	1.25	3.75	0.1250	0.675		
	1.9 - 2.8 y	1.75%	200	-100	100	100	1.75	1.75	0.1750			
	2.8 - 3.6 y	2.25%	100	-200	-100	100	2.25	-2.25	0.2250			
3	3.6 - 4.3 y	2.75%	300	-100	200	100	2.75	5.50	0.2750	7.80		
	4.3 - 5.7 y	3.25%	200	0	200	0	0.00	6.50	0.0000			
	5.7 - 7.3 y	3.75%	300	-100	200	100	3.75	7.50	0.3750			
	7.3 - 9.3 y	4.50%	0	-300	-300	0	0.00	-13.50	0.0000			
	9.3 - 10.6 y	5.25%	200	-100	100	100	5.25	5.25	0.5250			
	10.6 - 12 y	6.00%	300	-200	100	200	12.00	6.00	1.2000			
	12 - 20 y	8.00%	100	-100	0	100	8.00	0.00	0.8000			
> 20 y	12.50%	0	-100	-100	0	0.00	-12.50	0.0000				
								6.80	3.9200	8.56	0.48	0.00

Summen	
Zone 1	-1.20
Zone 2	3.25
Zone 3	4.75

EM-Bedarf:	19.76
------------	-------