

Zinsrisikomeldung per _____

Fragen zu den gemeldeten Daten und zum internen Risikomass

Bitte Ihren Code einsetzen

	Kol. 01
Messmethodik des internen Zinsrisikoindikators (Duration, VaR, etc.).....	

01

System mit welchem das Zinsrisiko gemessen wird.....	

02

Art der Behandlung der nichtlinearen Derivate im internen Zinsrisikoindikator (deltage-wichtete Positionen, Neubewertung, etc.)	

03

Wenn die Zinszahlungen der Kategorie I nicht gemeldet werden: kurze Begründung	

04

Weitere Abweichungen der Meldung gegenüber den gemäss Erläuterungen, Abschnitt 1 berücksichtigten Positionen	

05

