

# Zinsrisikomeldung (Internes Risikomass) per \_\_\_\_\_

in 1'000 Schweizer Franken

Bitte Ihren Code einsetzen

Für das Institut relevantes Zinsrisikomass (nur ein Indikator pro Währung)					Nettoinventarveränderung der Positionen der Kategorien I bis III bei Verschiebung der Zinskurve um		Nettoinventarveränderung der Positionen der Kategorie I bei Verschiebung der Zinskurve um	
Währungs Code <sup>1</sup> Kol. 01	Name des Indikators Kol. 02	Wert des Indikators			+ 100 Basispunkte Kol. 06	- 100 Basispunkte Kol. 07	+ 100 Basispunkte Kol. 08	- 100 Basispunkte Kol. 09
		in CHF Kol. 03	in Jahren Kol. 04	in % Kol. 05				
01		01	01	01	01	01	01	01
02		02	02	02	02	02	02	02
03		03	03	03	03	03	03	03
04		04	04	04	04	04	04	04
05		05	05	05	05	05	05	05
06		06	06	06	06	06	06	06
07		07	07	07	07	07	07	07
08		08	08	08	08	08	08	08
09		09	09	09	09	09	09	09
Total <sup>2</sup>		10	10	10	---	10	---	10

1) Angaben nur für jene Währungen, die im Formular ZR 101 berücksichtigt werden.

2) Internes Zinsrisikomass (aggregiert über sämtliche Währungen).

# Annnonce du risque de taux d'intérêt (indicateur interne), au \_\_\_\_\_

en milliers de francs suisses

Indiquez votre code s.v.p.

Indicateur de risque de taux d'intérêt pertinent pour la banque (un seul indicateur par monnaie)					Variation de la valeur actuelle nette des positions des catégories I à III pour un mouvement parallèle de la courbe des taux de		Variation de la valeur actuelle nette des positions de la catégorie I pour un mouvement parallèle de la courbe des taux de	
Code de la monnaie <sup>1</sup>  col. 01	Nom de l'indicateur  col. 02	Valeur de l'indicateur			+ 100 points de base  col. 06	- 100 points de base  col. 07	+ 100 points de base  col. 08	- 100 points de base  col. 09
		en CHF col. 03	en années col. 04	en % col. 05				
01		01	01	01	01	01	01	01
02		02	02	02	02	02	02	02
03		03	03	03	03	03	03	03
04		04	04	04	04	04	04	04
05		05	05	05	05	05	05	05
06		06	06	06	06	06	06	06
07		07	07	07	07	07	07	07
08		08	08	08	08	08	08	08
09		09	09	09	09	09	09	09
Total <sup>2</sup>		10	10	10	---	10	---	10

1) Les données doivent être fournies uniquement pour les monnaies prises en compte dans la formule ZR 101.

2) Mesure interne du risque de taux (après agrégation de l'ensemble des monnaies).