

## Anteile an verwalteten kollektiven Vermögen (VKV-Anteile)

Entwurfs-Version vom Juli 2022

ID	Label	Bezeichnung	Rechtliche Hinweise und Kommentare
Zeilen			
	Look-through Approach (LTA)	Look-through Ansatz (LTA)	ERV Art. 59a Bst.1 Bst. a KreV-FINMA Art. 118 Abs. 1, Art. 120, 121 und Art. 129
001	all funds under LTA	alle VKV-Anteile unter LTA	Alle VKV-Anteile, die nach der Hierarchie der Ansätze in KreV-FINMA Art. 118 unter dem LTA behandelt werden
002	of which: funds under LTA managed by the bank itself	davon: von der Bank selbst verwaltete kollektive Vermögen unter LTA	Von den in Zeile 001 gemeldeten VKV-Anteilen nur solche, die von der Bank selbst verwaltet werden
	Mandate Based Approach (MBA)	Mandatsbasierter Ansatz (MBA)	ERV Art. 59a Abs. 1 Bst. b KreV-FINMA Art. 122 bis 126 und Art. 129
003	all funds under MBA	alle VKV-Anteile unter MBA	Alle VKV-Anteile, die nach der Hierarchie der Ansätze in KreV-FINMA Art. 118 nach der MBA behandelt werden
004	of which: funds under MBA managed by the bank itself	davon: von der Bank selbst verwaltete kollektive Vermögen unter MBA	Von den in Zeile 003 gemeldeten VKV-Anteile nur solche, die von der Bank selbst verwaltet werden
	Fallback Approach (FBA)	Fallback-Ansatz (FBA)	ERV Art. 59a Abs. 1 Bst. c KreV-FINMA Art. 127 und Art. 129
005	all funds under FBA	alle VKV-Anteile unter FBA	Alle VKV-Anteile, die nach der Hierarchie der Ansätze in KreV-FINMA Art. 127 unter der FBA behandelt werden
006	of which: funds under FBA managed by the bank itself	davon: von der Bank selbst verwaltete kollektive Vermögen unter FBA	Von den in Zeile 005 gemeldeten VKV-Anteilen nur solche, die von der Bank selbst verwaltet werden.
	Simplified Approach	Vereinfachter Ansatz	ERV Art. 59a Bst. 1 Bst. d KreV-FINMA Art. 128 und Art. 129 Bst .4
007	all funds under Simplified Approach with 300%	alle VKV-Anteile im Rahmen des vereinfachten Ansatzes mit 300%	Alle VKV-Anteile, die nach der Hierarchie der Ansätze in KreV-FINMA Art. 118 nach dem vereinfachten Ansatz behandelt und mit 300% nach Risiko werden (KreV-FINMA Art. 128 Bst. 2 Bst. a)
008	of which: funds managed by the bank itself	davon: von der Bank selbst verwaltete kollektive Vermögen	Von den in Zeile 007 gemeldeten VKV-Anteile nur solche, die von der Bank selbst verwaltet werden.

024	all funds under Simplified Approach with 500%	alle VKV-Anteile im Rahmen des vereinfachten Ansatzes mit 500%	Alle VKV-Anteile, die nach der Hierarchie der Ansätze in KreV-FINMA Art. 118 nach dem vereinfachten Ansatz behandelt und mit 500% nach Risiko gewichtet werden (KreV-FINMA Art. 128 Bst. 2 Bst. b)
025	of which: funds managed by the bank itself	davon: von der Bank selbst verwaltete kollektive Vermögen	Von den in Zeile 024 gemeldeten VKV-Anteilen nur solche, die von der Bank selbst verwaltet werden.
009 - 013	LTA Exposure by weighted average risk weight applied	LTA-Position nach gewichtetem durchschnittlichem Risikogewicht	Für die in Zeile 001 gemeldeten Positionen: Aufschlüsselung in die Risikogewichtsbänder je nach gewichtetem durchschnittlichen Risikogewicht, das im Rahmen des LTA auf die VKV-Anteile angewandt wird.
014 - 018	MBA Exposure by weighted average risk weight applied	MBA-Position nach gewichtetem durchschnittlichen Risikogewicht	Für die in Zeile 001 gemeldeten Positionen: Aufschlüsselung in die Risikogewichtsbänder je nach gewichtetem durchschnittlichen Risikogewicht, das im Rahmen des MBA auf die VKV-Anteile angewandt wird.
019	Simplified Approach 300% risk weight	Vereinfachter Ansatz 300% Risikogewicht	Gleiche Positionen wie in Zeile 007 gemeldet
xx	of which: having synthetic risk indicator value of 1 to 4	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert von 1 bis 4	Von den in Zeile 019 gemeldeten Positionen diejenigen mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 1 bis 4 nach Finanzdienstleistungsverordnung (FIDLEV) Anhang 9 Ziffer 4.2
xx	of which: having synthetic risk indicator value of 5 to 7	davon: mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 5 bis 7	Von den in Zeile 019 gemeldeten Positionen diejenigen mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 5 bis 7 nach Finanzdienstleistungsverordnung (FIDLEV) Anhang 9 Ziffer 4.2
029	Simplified Approach 500% risk weight	Vereinfachter Ansatz 500% Risikogewicht	Gleiche Positionen wie in Zeile 024 gemeldet
xx	of which: having synthetic risk indicator value of 1 to 4	davon: mit synthetischem Risikoindikatorwert von 1 bis 4	Von den in Zeile 029 gemeldeten Positionen diejenigen mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 1 bis 4 nach Finanzdienstleistungsverordnung (FIDLEV) Anhang 9 Ziffer 4.2
xx	of which: having synthetic risk indicator value of 5 to 7	davon: mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 5 bis 7	Von den in Zeile 029 gemeldeten Positionen diejenigen mit einem synthetischen Risikoindikatorwert von 5 bis 7 nach Finanzdienstleistungsverordnung (FIDLEV) Anhang 9 Ziffer 4.2
<b>Rubriken</b>			
01	Number of funds	Anzahl der verwalteten kollektiven Vermögen	Anzahl der kollektiv verwalteten Vermögen, an denen die Bank Anteile hält. Wird ein kollektiv verwaltetes Vermögen nach mehr als einem Ansatz behandelt, so ist es unter jedem Ansatz zu zählen.
02	Credit equivalent for CCR of SFT	Kreditäquivalent für das Gegenparteikreditrisiko von SFT	Kreditäquivalent für das Gegenparteikreditrisiko aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ERV Art. 62 und KreV-FINMA Art. 38 und 65 bis 82)
03	Credit equivalent for CCR of derivatives	Kreditäquivalent für das Gegenparteikreditrisiko von Derivaten	Kreditäquivalent für das Gegenparteikreditrisiko aus Derivaten (ERV Art. 56 bis 58 und KreV-FINMA Art. 3 bis 39)

04	Risk weighted exposure amount for CCR of SFT and derivatives (incl. CVA)	Risikogewichtete Position für das Gegenparteikreditrisiko von SFT und Derivaten (inkl. CVA)	Betrag, der sich aus der Multiplikation der in den Spalten 02 und 03 gemeldeten Kreditäquivalenten mit ihren zugehörigen Risikogewichten ergibt
05	Total (net) exposure before risk weighting	Gesamte (Netto-)Position vor Risikogewichtung	Gesamte (Netto-)Position, die sich aus VKV-Anteilen ergibt. Sie umfasst die Kreditäquivalente für das Gegenparteikreditrisiko, die in den Spalten 02 und 03 gemeldet werden.
06	Risk weighted exposure amount	Risikogewichtete Position	Betrag, der sich aus der Multiplikation der gesamten (Netto-) Position in Spalte 05 mit dem zugehörigen Risikogewicht ergibt