

## Einfacher Marktrisiko-Standardansatz

Entwurfs-Version vom Juli 2022

ID	Label	Bezeichnung	Rechtliche Hinweise und Kommentare
<b>Spalten</b>			
1	Position	Position	
2	Scaling / Requirement factor	Skalierungsaktor/Anforderungsfaktor	Skalierungs-/Anforderungsfaktoren sind vorausgefüllt und dürfen nicht verändert werden.
3	Amount	Betrag	Mindesteigenmittelanforderung (für eine bestimmte Position) oder Zwischenergebnis für die Berechnung der Mindesteigenmittelanforderung. Falls ein Skalierungs- oder Anforderungsfaktor angegeben ist (Spalte 2), wird der Betrag als Produkt aus Spalte 1 und 2 berechnet.
<b>Zeilen</b>			
1.	Minimum requirements for market risks according to the simple standardised approach Arts. 83-86a Capital Ordinance	Mindestanforderungen für Marktrisiken nach dem einfachen Marktrisiko-Standardansatz Art. 83-86a ERV	ERV Art. 83-86a in Verbindung mit MarV-FINMA Kapitel 2
1.1	Market risk of currencies	Marktrisiko von Währungen	
1.1.a	Total before application of scaling factor	Gesamtbetrag vor Anwendung des Skalierungsfaktors	1.1.a = 1.1.1 + 1.1.2 für den Betrag (Spalte 3).
1.1.b	Total after application of scaling factor	Gesamtbetrag nach Anwendung des Skalierungsfaktors	Der Skalierungsfaktor und dessen Anwendung richten sich nach ERV Art. 83a.
1.1.1	Currencies	Währungen	ERV Art. 86 Abs. 1 in Verbindung mit MarV-FINMA Art. 24-26. Wendet eine Bank für Optionen die Delta-Plus-Methode an, so sind hier die entsprechenden Positionen für das Delta-Risiko zu erfassen. Ansonsten sind Optionen auf Fremdwährungen nicht enthalten.
1.1.2	Options on currencies	Optionen auf Währungen	MarV-FINMA Kapitel 2 Abschnitt 5. Die Banken können unter bestimmten Voraussetzungen zwischen drei verschiedenen Ansätzen wählen, vgl. Punkt 2. Wendet eine Bank die Delta-Plus-Methode an, so sind die Mindestanforderungen für das Delta-Risiko nicht hier, sondern unter Punkt 1.1.1 zu erfassen.
1.2	Market risk of gold	Marktrisiko von Gold	
1.2.a	Total before application of scaling factor	Gesamtbetrag vor Anwendung des Skalierungsfaktors	1.2.a = 1.2.1 + 1.2.2 für den Betrag (Spalte 3).
1.2.b	Total after application of scaling factor	Gesamtbetrag nach Anwendung des Skalierungsfaktors	Der Skalierungsfaktor und seine Anwendung richten sich nach ERV Art. 83a.

1.2.1	Gold	Gold	ERV Art. 86 Abs. 2 in Verbindung mit MarV-FINMA Art. 24-26. Wendet eine Bank bei Optionen die Delta-Plus-Methode an, so sind hier die entsprechenden Positionen für das Delta-Risiko zu erfassen. Ansonsten sind Optionen auf Fremdwährungen nicht enthalten.
1.2.2	Options on gold	Optionen auf Gold	MarV-FINMA Kapitel 2 Abschnitt 5. Die Banken können zwischen drei verschiedenen Ansätzen wählen, vgl. Punkt 2. Wendet eine Bank die Delta-Plus-Methode an, so sind die Mindestanforderungen für das Delta-Risiko nicht hier, sondern unter Punkt 1.2.1 zu erfassen.
1.3	Market risk of commodities	Marktrisiko von Rohstoffen	
1.3.a	Total before application of scaling factor	Gesamtbetrag vor Anwendung des Skalierungsfaktors	1.3.a = 1.3.1 + 1.3.2 + 1.3.3 für den Betrag (Spalte 3).
1.3.b	Total after application of scaling factor	Gesamtbetrag nach Anwendung des Skalierungsfaktors	Der Skalierungsfaktor und seine Anwendung richten sich nach ERV Art. 83a .
1.3.1	Commodities according to the maturity ladder approach	Rohstoffe nach dem Laufzeitbandverfahren	ERV Art. 86a in Verbindung mit MarV-FINMA Art. 27-31.
1.3.2	Commodities according to the simplified approach	Rohstoffe nach dem vereinfachten Ansatz	Die Banken können zwischen einem Laufzeitbandverfahren (Ziff. 1.3.1) und einem vereinfachten Ansatz (Ziff. 1.3.2) wählen. Wendet eine Bank für Optionen die Delta-Plus-Methode an, so sind hier die für das Delta-Risiko relevanten Positionen zu erfassen. Ansonsten werden Optionen auf Fremdwährungen nicht einbezogen.
1.3.3	Options on commodities	Optionen auf Rohstoffe	MarV-FINMA Kapitel 2 Abschnitt 5. Die Banken können unter bestimmten Voraussetzungen zwischen drei verschiedenen Ansätzen wählen, vgl. Punkt 2. Verwendet eine Bank die Delta-Plus-Methode, so sind die Mindestanforderungen für das Delta-Risiko nicht hier, sondern unter Punkt 1.3.1 und 1.3.2 zu erfassen.
1.4	Market risk of interest rate instruments	Marktrisiko von Zinsinstrumenten	
1.4.1	De-minimis requirements according to banking book rules after application of multiplier of 2.5: Interest rate instruments	De-minimis-Anforderungen nach den Regeln des Anlagebuchs nach Anwendung des Multiplikators von 2,5: Zinsinstrumente	ERV Art. 83 Abs. 3 in Verbindung mit MarV-FINMA Art. 50-53. Die Anwendung des De-minimis-Ansatzes setzt das Bestehen des De-minimis-Tests voraus, siehe Punkt 3.
1.4.2.a	If De-minimis not used: Total before application of scaling factor	Wenn De-minimis nicht verwendet wird: Gesamtbetrag vor Anwendung des Skalierungsfaktors	1.4.2.a = 1.4.2.1 + 1.4.2.2 + 1.4.2.3 für den Betrag (Spalte 3).
1.4.2.b	If De-minimis not used: Total after application of scaling factor	Wenn De-minimis nicht verwendet wird: Gesamtbetrag nach Anwendung des Skalierungsfaktors	Der Skalierungsfaktor und seine Anwendung sind in Art. 83a CAO.

1.4.2.1	Specific risk of interest rate instruments	Spezifisches Risiko von Zinsinstrumenten	1.4.2.1 = 1.4.2.1.1 + 1.4.2.1.2 für den Betrag (Spalte 3). Wenn eine Bank die Delta-Plus-Methode für Optionen anwendet, sind die entsprechenden Positionen für das Delta-Risiko hier einzutragen. Ansonsten werden Optionen auf Fremdwährungen weder in dieser Position noch in den Unterpositionen erfasst.
1.4.2.1.1	Non-Securitisation Positions	Nicht-Verbriefungspositionen	
1.4.2.1.1.1	Government and central bank interest rate instruments	Zinsinstrumente Zentralstaaten und Zentralbanken	
1.4.2.1.1.1.1	Rating class 1 or 2	Ratingklasse 1 oder 2	
1.4.2.1.1.1.2	Rating class 3 or 4	Ratingklasse 3 oder 4	
1.4.2.1.1.1.2.1	Residual term to final maturity ≤ 6 months	Restlaufzeit bis zur Endfälligkeit ≤ 6 Monate	
1.4.2.1.1.1.2.2	Residual term to final maturity > 6 months and ≤ 24 months	Restlaufzeit bis zur Endfälligkeit > 6 Monate und ≤ 24 Monate	
1.4.2.1.1.1.2.3	Residual term to final maturity > 24 months	Restlaufzeit bis zur Endfälligkeit > 24 Monate	
1.4.2.1.1.1.3	Rating class 5 or 6	Ratingklasse 5 oder 6	
1.4.2.1.1.1.4	Rating class 7	Ratingklasse 7	
1.4.2.1.1.1.5	Unrated	Ohne Rating	MarV-FINMA Art. 17 Abs. 1 in Verbindung mit ERV Art. 84 Abs. 1 und Anhang 5.
1.4.2.1.1.2	Qualified interest rate instruments according to art. 4 let. g Capital Ordinance	Qualifizierte Zinsinstrumente im Sinne von ERV Art. 4 Bst. g	
1.4.2.1.1.2.1	Residual term to final maturity ≤ 6 months	Restlaufzeit bis zur Endfälligkeit ≤ 6 Monate	
1.4.2.1.1.2.2	Residual term to final maturity > 6 months and ≤ 24 months	Restlaufzeit bis zur Endfälligkeit > 6 Monate und ≤ 24 Monate	
1.4.2.1.1.2.3	Residual term to final maturity > 24 months	Restlaufzeit bis zur Endfälligkeit > 24 Monate	
1.4.2.1.1.3	Other interest rate instruments	Sonstige zinsbezogene Instrumente	
1.4.2.1.1.3.1	Rating class 5	Ratingklasse 5	
1.4.2.1.1.3.2	Rating class 6 or 7	Ratingklasse 6 oder 7	
1.4.2.1.1.3.3	Unrated	Ohne Rating	
1.4.2.1.2	Securitisation Positions (according to banking book rules)	Verbriefungspositionen (nach den Regeln des Bankenbuchs)	MarO-FINMA Art. 17 Abs. 2 in Verbindung mit KreV-FINMA Art. 134-137.
1.4.2.2	General market risk of interest rate instruments	Allgemeines Marktrisiko von Zinsinstrumenten	ERV Art. 84 Abs. 2 in Verbindung mit MarV-FINMA Art. 13-16. Wendet eine Bank für Optionen die Delta-Plus-Methode an, so sind die entsprechenden Positionen für das Delta-Risiko hier zu erfassen. Ansonsten werden Optionen auf Fremdwährungen weder in dieser Position noch in den Unterpositionen erfasst.
1.4.2.2.1	Value according to the maturity method	Wert nach dem Laufzeitbandmethode	MarV-FINMA Art. 14 .
1.4.2.2.2	Value according to the duration method	Wert nach der Durationsmethode	MarV-FINMA .Art. 16

1.4.2.3	Requirements for options on interest rate instruments	Anforderungen für Optionen auf Zinsinstrumente	MarV-FINMA Kapitel 2 Abschnitt 5. Die Banken können unter bestimmten Voraussetzungen zwischen drei verschiedenen Ansätzen wählen, vgl. Punkt 2. Verwendet eine Bank die Delta-Plus-Methode, so sind die Mindestanforderungen für das Delta-Risiko nicht hier, sondern in den Punkten 1.4.2.1 - 1.4.2.2 zu erfassen.
1.5	Market risk of equity instruments	Marktrisiko von Aktieninstrumenten	
1.5.1	De-minimis requirements according to banking book rules after application of multiplier of 2.5: Equities	De-minimis-Anforderungen nach den Regeln des Bankbuchs nach Anwendung des Multiplikators von 2,5: Aktieninstrumente	ERV Art. 83 Abs. 3 in Verbindung mit MarV-FINMA Art. 50-53. Die Anwendung des De-minimis-Ansatzes setzt das Bestehen des De-minimis-Tests voraus, siehe Punkt 3.
1.5.2.a	If De-minimis not used: Total before application of scaling factor	Wenn De-minimis nicht verwendet wird: Gesamtbetrag vor Anwendung des Skalierungsfaktors	1.5.2.a = 1.5.2.1 + 1.5.2.2 + 1.5.2.3 für den Betrag (Spalte 3).
1.5.2.b	If De-minimis not used: Total after application of scaling factor	Wenn De-minimis nicht verwendet wird: Gesamtbetrag nach Anwendung des Skalierungsfaktors	Der Skalierungsfaktor und seine Anwendung richten sich nach ERV Art. 83a.
1.5.2.1	Specific risk of equity	Spezifisches Risiko des Eigenkapitals	ERV Art. 85 Abs. 1 in Verbindung mit MarV-FINMA Art. 18-23.
1.5.2.1.1	Sum of the net positions by emission	Summe der Nettopositionen nach Emissionen	Wendet eine Bank für Optionen die Delta-Plus-Methode an, so sind hier die entsprechenden Positionen für das Delta-Risiko zu erfassen. Ansonsten sind Optionen auf Fremdwährungen nicht enthalten.
1.5.2.2	General market risk of equity	Allgemeines Marktrisiko von Aktieninstrumenten	ERV Art. 85 Abs. 2 in Verbindung mit MarV-FINMA Art. 18-23.
1.5.2.2.1	Sum of the net positions by national market	Summe der Nettopositionen nach nationalen Märkten	Wendet eine Bank für Optionen die Delta-Plus-Methode an, so sind hier die entsprechenden Positionen für das Delta-Risiko zu erfassen. Ansonsten sind Optionen auf Fremdwährungen nicht enthalten.
1.5.2.3	Requirements for equity options	Anforderungen für Aktienoptionen	MarV-FINMA Kapitel 2 Abschnitt 5. Die Banken können unter bestimmten Voraussetzungen zwischen drei verschiedenen Ansätzen wählen, vgl. Punkt 2. Verwendet eine Bank die Delta-Plus-Methode, so sind die Mindestanforderungen für das Delta-Risiko nicht hier, sondern in den Punkten 1.5.2.1 - 1.5.2.2 zu erfassen.
2	Memorandum item: Options	Pro memoria: Optionen	
2.1	Requirements for options according to the simplified approach	Anforderungen für Optionen nach dem vereinfachten Ansatz	MarV-FINMA Art. 43.
2.1.1	Options on interest rate instruments	Optionen auf Zinsinstrumente	
2.1.2	Options on stocks or stock indices	Optionen auf Aktien oder Aktienindizes	

2.1.3	Options on currencies	Optionen auf Währungen	
2.1.4	Options on gold	Optionen auf Gold	
2.1.5	Options on commodities	Optionen auf Rohstoffe	
2.2	Requirements for options according to the delta-plus method	Voraussetzungen für Optionen nach der Delta-Plus-Methode	MarV-FINMA Art. 34 -38. Anforderungen an Delta-Risiken von Optionen (MarV-FINMA Art. 35) sind nicht unter Ziffer 2.2, sondern direkt unter Ziffer 1 zu erfassen.
2.2.1	Gamma risk	Gamma-Risiko	MarV-FINMA Art. 36 bis 37.
2.2.1.1	Options on interest rate instruments	Optionen auf Zinsinstrumente	
2.2.1.2	Options on stocks or stock indices	Optionen auf Aktien oder Aktienindizes	
2.2.1.3	Options on currencies	Optionen auf Währungen	
2.2.1.4	Options on gold	Optionen auf Gold	
2.2.1.5	Options on commodities	Optionen auf Rohstoffe	
2.2.2	Vega risk	Vega-Risiko	MarV-FINMA Art. 38.
2.2.2.2	Options on interest rate instruments	Optionen auf Zinsinstrumente	
2.2.2.3	Options on stocks or stock indices	Optionen auf Aktien oder Aktienindizes	
2.2.2.4	Options on currencies	Optionen auf Währungen	
2.2.2.5	Options on gold	Optionen auf Gold	
2.2.2.6	Options on commodities	Optionen auf Rohstoffe	
2.3	Requirements for options according to the scenario analysis approach	Anforderungen an Optionen nach dem Ansatz der Szenarioanalyse	MarV-FINMA Art. 39 bis 42.
2.3.1	Options on interest rate instruments	Optionen auf Zinsinstrumente	
2.3.2	Options on stocks or stock indices	Optionen auf Aktien oder Aktienindizes	
2.3.3	Options on currencies	Optionen auf Währungen	
2.3.4	Options on gold	Optionen auf Gold	
2.3.5	Options on commodities	Optionen auf Rohstoffe	
3.	Memorandum item: De-minimis test	Pro memoria: De-minimis-Test	Auszufüllen und zu bestehen, wenn De-Minimis-Ansatz gemäss OPT-Formular, Punkt 3.1 verwendet wird
3.1	Total of balance and off-balance sheet	Summe der bilanziellen und ausserbilanziellen Posten	3.1 = 3.1.1 + 3.1.2 für den Betrag (Spalte 3).
3.1.1	Total of last quarter's balance sheet	Bilanzsumme des letzten Quartals	
3.1.2	Contingent liabilities, irrevocable credit lines granted, contingent liabilities for calls and margin liabilities, commitment credits and the contract volume of all open derivative financial instruments	Eventualverbindlichkeiten, unwiderrufliche Zusagen, Einzahlungs- und Nachschussverpflichtungen, Verpflichtungskredite und Kontraktvolumen aller offenen Derivate	MarV-FINMA Art. 50. Es sind absolute Werte zu verwenden.
3.2	Trading book (art. 5 Capital Ordinance)	Handelsbuch (ERV Art. 5)	MarV-FINMA Art. 51 und 52.
3.2.1	Trading book in % of the total of balance and off-balance sheet	Handelsbuch in % der Summe der bilanziellen und ausserbilanziellen Posten	

Weitere Informationen finden Sie unter ...:

- Letzte Umfrage-Updates
- Elektronische Formulare zum Herunterladen
- Wichtige Informationen zur Berichterstattung
- Ansprechpartner

E\_PC\_MKR\_SSA\_Notes.fm/