

Marktrisiko-Standardansatz

Entwurfs-Version vom Juli 2022

ID	Label	Bezeichnung	Rechtliche Hinweise und Kommentare
Spalten			
1	Total	Total	Gegebenenfalls ist der Gesamtbetrag die Summe aus Delta, Vega und Krümmung.
2	Delta	Delta	MAR10.14, die Anforderungen für die Berechnung und Aggregation werden in MAR21 näher erläutert.
3	Vega	Vega	MAR10.15, die Anforderungen für die Berechnung und Aggregation werden in MAR21 näher erläutert.
4	Curvature	Krümmung	MAR10.16, die Anforderungen für die Berechnung und Aggregation werden in MAR21 näher erläutert.
Zeilen			
1	Minimum requirements for market risks according to the standardised approach	Mindestanforderungen für Marktrisiken nach dem Marktrisiko-Standardansatz	MAR20.4 ERV Art. 87 in Verbindung mit MarV-FINMA Art. 54. Die FINMA stützt sich auf die Basler Rahmenvereinbarung, insbesondere auf MAR20-23.
1.1	Capital requirement under the Sensitivities-based method (SbM)	Eigenmittelanforderung nach der auf Sensitivitäten basierenden Methode (SbM)	MAR 21
1.1.1	Low correlations	Niedrige Korrelationen	MAR 21.6
1.1.1.1	General interest rate risk	Allgemeines Zinsänderungsrisiko	
1.1.1.2	Equity risk	Aktienpreisrisiko	
1.1.1.3	Commodity risk	Rohstoffrisiko	
1.1.1.4	Foreign exchange risk	Fremdwährungsrisiko	
1.1.1.5	Credit spread risk – non-securitisations	Credit-Spread-Risiko - Nicht-Verbriefungen	
1.1.1.6	Credit spread risk – securitisations (non-correlation trading portfolio)	Credit-Spread-Risiko - Verbriefungen (Nicht-Korrelationshandelsportfolio)	
1.1.1.7	Credit spread risk – securitisation (correlation trading portfolio)	Credit-Spread-Risiko - Verbriefung (Korrelationshandelsportfolio)	
1.1.2	Medium correlations	Mittlere Korrelationen	MAR 21.6
1.1.2.1	General interest rate risk	Allgemeines Zinsänderungsrisiko	
1.1.2.2	Equity risk	Aktienpreisrisiko	
1.1.2.3	Commodity risk	Rohstoffrisiko	
1.1.2.4	Foreign exchange risk	Fremdwährungsrisiko	
1.1.2.5	Credit spread risk – non-securitisations	Credit-Spread-Risiko - Nicht-Verbriefungen	

1.1.2.6	Credit spread risk – securitisations (non-correlation trading portfolio)	Credit-Spread-Risiko - Verbriefungen (Nichtkorrelationshandelsportfolio)	
1.1.2.7	Credit spread risk – securitisation (correlation trading portfolio)	Credit-Spread-Risiko - Verbriefung (Korrelationshandelsportfolio)	
1.1.3	High correlations	Hohe Korrelationen	MAR 21.6
1.1.3.1	General interest rate risk	Allgemeines Zinsänderungsrisiko	
1.1.3.2	Equity risk	Aktienpreissrisiko	
1.1.3.3	Commodity risk	Rohstoffrisiko	
1.1.3.4	Foreign exchange risk	Fremdwährungsrisiko	
1.1.3.5	Credit spread risk – non-securitisations	Credit-Spread-Risiko - Nicht-Verbriefungen	
1.1.3.6	Credit spread risk – securitisations (non-correlation trading portfolio)	Credit-Spread-Risiko - Verbriefungen (Nicht-Korrelationshandelsportfolio)	
1.1.3.7	Credit spread risk – securitisation (correlation trading portfolio)	Credit-Spread-Risiko - Verbriefung (Korrelationshandelsportfolio)	
1.2	Default risk capital requirement (DRC)	Eigenmittelanforderung für das Ausfallrisiko (DRC)	MAR22
1.2.1	Non-securitisation	Nicht-Verbriefung	MAR22.9 - MAR22.26
1.2.1.1	Corporates	Unternehmen	MAR 22.22, 22.26
1.2.1.2	Sovereigns	Staaten	MAR 22.22, 22.26
1.2.1.3	Local governments and municipalities	Lokale Regierungen und Gemeinden	MAR 22.22, 22.26
1.2.2	Securitisation (non-CTP)	Verbriefung (nicht CTP)	MAR22.27 - MAR22.35
1.2.3	Securitisation (CTP)	Verbriefung (CTP)	MAR22.36 - MAR22.45
1.3	Residual risk add-on	Zusatz zum Restrisiko	MAR23
1.3.1	Exotic underlying	Exotischer Basiswert	MAR23.3; der ausgewiesene Betrag beinhaltet das Risikogewicht von 1% (siehe MAR 23.8 (2) (a)).
1.3.2	Non-exotic underlying	Nicht exotische Basiswerte	MAR23.4, MAR23.5; der ausgewiesene Betrag beinhaltet das Risikogewicht von 0,1% (siehe MAR 23.8 (2) (b)).
1.3.2.1	Behavioural risk	Verhaltensbedingtes Risiko	MAR 23.5 (3); der ausgewiesene Betrag enthält das Risikogewicht von 0,1%.
1.3.2.1.1	Pre-payment	Vorauszahlung	Instrumente mit vorzeitiger Rückzahlung (MAR 23.5 (3)); der ausgewiesene Betrag beinhaltet das Risikogewicht von 0,1%
1.3.2.1.2	Other behavioural	Andere Verhaltensweisen	Instrumente mit anderen Ausübungsmöglichkeiten für Privatkunden als der Vorauszahlung (MAR 23.5 (3)); der ausgewiesene Betrag beinhaltet das Risikogewicht von 0,1%
1.3.2.2	Correlation risk (excl. instruments with behavioural risk)	Korrelationsrisiko (ohne Instrumente mit Verhaltensrisiko)	MAR 23.5 (2), jedoch ohne Instrumente mit Verhaltensrisiko; der ausgewiesene Betrag enthält das Risikogewicht von 0,1%
1.3.2.3	Gap risk (excl. instruments with correlation risk and / or behavioural risk)	Lückenrisiko (ohne Instrumente mit Korrelationsrisiko und/oder Verhaltensrisiko)	MAR 23.5 (1), jedoch unter Ausschluss von Instrumenten mit mehreren Basiswerten und/oder Verhaltensrisiken; der ausgewiesene Betrag enthält das Risikogewicht von 0,1%.

1.3.2.4	Other residual risk with non-exotic underlying	Sonstiges Restrisiko mit nicht exotischen Basiswerten	Der ausgewiesene Betrag enthält die Risikogewichtung von 0,1%.
---------	--	---	--

Weitere Informationen finden Sie unter ...:

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

E_PC_MKR_SA_Notes.fm/