

## Risiko aus nicht abgewickelten Transaktionen

Entwurfs-Version vom Juli 2022

ID	Label	Bezeichnung	Rechtliche Hinweise und Kommentare
<b>Spalten</b>			
01	Exposure due to unsettled transactions	Positionen aus nicht abgewickelten Transaktionen	ERV Art. 77f. Differenz zwischen dem vertraglichen Abrechnungspreis und dem aktuellen Marktwert.
02	Risk-weighted Assets	Nach Risiko gewichtete Positionen	Betrag der nach Risiko gewichteten Positionen aus nicht abgewickelten Transaktionen, unter Anwendung der unten aufgeführten Risikogewichte.
<b>Zeilen</b>			
01	Total unsettled transactions	Total der nicht abgewickelten Transaktionen	ERV Art. 77f Abs. 1
	Settled via a DvP or PVP system, of which:	abgewickelt über ein LgZ- oder ZgZ-System, von denen:	ERV Art. 77f Abs. 2 Positionen, die über ein "Lieferung-gegen-Zahlung"- oder "Zahlung-gegen-Zahlung"-System abgewickelt werden.
02	Transactions unsettled between 5 and 15 days	Zwischen 5 und 15 Bankwerktage nach dem vereinbarten Erfüllungstermin nicht abgewickelte Transaktionen	Diese Positionen erhalten ein Risikogewicht von 100%.
03	Transactions unsettled between 16 and 30 days	Zwischen 16 und 30 Bankwerktage nach dem vereinbarten Erfüllungstermin nicht abgewickelte Transaktionen	Diese Positionen erhalten ein Risikogewicht von 625%.
04	Transactions unsettled between 31 and 45 days	Zwischen 31 und 45 Bankwerktage nach dem vereinbarten Erfüllungstermin nicht abgewickelte Transaktionen	Diese Positionen erhalten ein Risikogewicht von 937,5%.
05	Transactions unsettled for 46 days or more	Seit 46 Bankwerktagen oder länger nach dem vereinbarten Erfüllungstermin nicht abgewickelte Transaktionen	Diese Positionen erhalten ein Risikogewicht von 1250%.
	Settled not via a DvP or PVP system, of which:	nicht abgewickelt über ein LgZ- oder ZgZ-System:	ERV Art. 77f Abs. 3 Positionen, die nicht über ein "Lieferung-gegen-Zahlung"- oder "Zahlung-gegen-Zahlung"-System abgewickelt werden.
xx	Bank delivered, waiting for counterparty to deliver (up to four banking days after agreed settlement date)	Die Bank hat geliefert, wartet auf die Lieferung der Gegenpartei (bis zu vier Bankarbeitstage nach dem vereinbarten Erfüllungstermin)	Diese Positionen erhalten ein Risikogewicht von 100%.
xx	Bank delivered, waiting for counterparty to deliver: five or more banking days after agreed	Die Bank hat geliefert, wartet auf die Lieferung der Gegenpartei seit fünf oder mehr Bankarbeitstagen nach dem vereinbarten Erfüllungstermin	Diese Positionen erhalten ein Risikogewicht von 1250%.

---

settlement date

---

Weitere Informationen finden Sie auf unserer Website unter ...

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

E\_PC\_SETT\_Notes .fm/