

Zentrale Gegenparteien (CCP)

Entwurfs-Version vom Juli 2022

Dieses Formular umfasst alle Geschäfte, die in wirtschaftlicher Betrachtung einem Geschäft mit einer CCP gleichkommen (z.B. ein direktes Clearingmitglied, das als Agent oder Auftraggeber in einem für Kunden geclearten Geschäft auftritt). Diese Geschäfte und ihre Behandlung richten sich nach ERV Art. 77a bis 77e und KreV-FINMA Art. 134 bis 152.

ID	Label	Bezeichnung	Rechtliche Hinweise und Kommentare
Zeilen			
001	Exposures to QCCPs (total)	Positionen gegenüber QCCPs (Total)	<ul style="list-style-type: none"> Definition einer qualifizierten zentralen Gegenpartei (QCCP) nach ERV Art. 77a Abs. 2 Behandlung nach ERV Art. 77d
011	Exposures to non-QCCPs (total)	Positionen gegenüber Nicht-QCCP (Total)	<ul style="list-style-type: none"> Behandlung nach ERV Art. 77c
002 011	Exposures for trades at [QCCPs / non-QCCPs] (excluding initial margin and default fund contributions); of which	Positionen aus Handelsgeschäften [mit QCCPs / CCPs] (ohne Anfangsmarge und Ausfallfondsbeiträge); davon	<p>Dazu gehören Positionen aus Handelsgeschäften für eigene Rechnung sowie Positionen aus Handelsgeschäften, für die die Bank dem Clearingkunden die Leistung der zentralen Gegenpartei garantiert. Die Position muss das aktuelle und potenzielle künftige Engagement eines Clearingmitglieds oder eines Kunden gegenüber einer CCP umfassen. Für die Zwecke dieser Definition umfasst die aktuelle Forderung eines Clearingmitglieds auch die dem Clearingmitglied geschuldete, aber noch nicht erhaltene Nachschusszahlung.</p> <ul style="list-style-type: none"> Definition nach ERV Art. 77b Abs. 1 Bst. a und b, Art. 77b Abs. 2, jedoch ohne Anfangsmarge Behandlung im Falle von QCCPs nach ERV Art. 77d Abs. 1 und Art. 77d Abs. 4 sowie KreV-FINMA Art. 143 und 151 Behandlung im Falle von Nicht-QCCPs nach ERV Art. 77c Abs. 1
003 013	(i) OTC derivatives	(i) OTC-Derivate	Dazu gehören auch OTC-Geschäfte mit langer Abwicklungsdauer (ERV Art. 56)
004 014	(ii) Exchange-traded derivatives	(ii) Börsengehandelte Derivate	Dazu gehören auch börsengehandelte Geschäfte mit langer Abwicklungsdauer (d.h. börsengehandelte Wertpapiere oder Waren mit einem Abwicklungs- oder Lieferdatum von mehr als fünf Tagen) (ERV Art. 56)
005 015	(iii) Securities financing transactions	(iii) Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	
006 016	(iv) Netting sets where cross-product netting has been approved	(iv) Netting-Sets, bei denen produktübergreifendes Netting genehmigt wurde	

007 017	Segregated initial margin	Segregierte Anfangsmarge	ERV Art. 77b Abs. 2 Bst. d und KreV-FINMA Art. 136 Segregiert bezieht sich auf Sicherheiten, die in insolvenz sicherer Form gehalten werden. Wenn die Bedingungen in KreV-FINMA Art. 151 Abs. 2 erfüllt sind, unterliegt diese Position bei QCCPs keinen Mindestkapitalanforderungen (d.h. 0% Risikogewicht).
008 018	Non-segregated initial margin	Unsegregierte Anfangsmarge	ERV Art. 77b Abs. 2 Bst. d und KreV-FINMA Art. 136 Unsegregiert bezieht sich auf Sicherheiten, die nicht in insolvenz sicher Form gehalten werden.
009 019	Pre-funded default fund contributions	Vorfinanzierte Ausfallfondsbeiträge	Vorfinanzierte Beiträge zum Ausfallfonds sind vorfinanzierte Beiträge der Clearingmitglieder zu den auf Gegenseitigkeit beruhenden Verlustteilungsvereinbarungen einer CCP oder deren Übernahme. <ul style="list-style-type: none"> • Definition: siehe KreV-FINMA Art. 138 • Behandlung im Falle von QCCPs: ERV Art. 77d Abs. 2 • Behandlung im Falle von Nicht-QCCP: ERV Art. 77c Abs.2 Bst. a
010 020	Unfunded default fund contributions	Nicht vorfinanzierte Ausfallfondsbeiträge	Nicht vorfinanzierte Ausfallfondsbeiträge sind nicht gedeckte Beiträge von Clearingmitgliedern zur gegenseitigen Verlustbeteiligung einer CCP oder die Übernahme dieser Beiträge. Wenn eine Bank kein Clearingmitglied, sondern ein Kunde eines Clearingmitglieds, sollte sie ihre Engagements in Bezug auf nicht finanzierte Ausfallfondsbeiträge angeben, falls zutreffend. Andernfalls sollten die Banken diese Zeile leer lassen und den Grund dafür in den beigefügten Erläuterungen erläutern. <ul style="list-style-type: none"> • Definition: siehe KreV-FINMA Art. 138 • Behandlung im Falle von QCCPs: keine Eigenmittelanforderungen • Behandlung im Falle von Nicht-QCCP: ERV Art. 77c Abs. 2 Bst. b und Abs. 3
Rubriken			
	EAD (post-CRM)	EAD (nach Kreditrisikominderungs massnahmen)	Position bei Ausfall. Der Betrag, der für die Berechnung der Eigenmittelanforderungen relevant ist, nachdem Kreditrisikominderungs massnahmen, Kreditbewertungsanpassungen nach KreV-FINMA Art. 153 Abs. 2 Bst. c [CRE51.11] und Anpassungen für spezifisches Wrong-way-Risiko (siehe KreV-FINMA Art. 38 Abs. 2 [CRE53]) angewendet wurden.
	RWA	RWA	<ul style="list-style-type: none"> • Für Handelsgeschäfte (d.h. aktuelle und potenzielle künftige Risikoposition sowie Anfangsmarge) und Ausfallfondsbeiträge gegenüber Nicht-QCCPs: $RWA = EAD * \text{anwendbares Risikogewicht}$ • Für Ausfallfondsbeiträge gegenüber QCCPs: $RWA = \text{Eigenmittelanforderungen nach ERV Anhang 4} * 12,5$