

Marktrisiko-Modellansatz

Entwurfs-Version vom Juli 2022

ID	Label	Bezeichnung	Rechtliche Hinweise und Kommentare
Rubriken			
1	Value	Wert	
2	Most recent value	Aktuellster Wert	
3	Average over last quarter	Durchschnitt des letzten Quartals	
4	Highest value of last quarter	Höchster Wert des letzten Quartals	
5	Lowest value of last quarter	Niedrigster Wert des letzten Quartals	
Zeilen			
1.	Minimum requirements for market risks according to the internal models approach	Mindestanforderungen für Marktrisiken nach dem Marktrisiko-Modellansatz	Basler Dokument MAR33.43. Die Verwendung des Marktrisiko-Modellansatzes erfordert die Einhaltung von ERV Art. 88 in Verbindung mit MarV-FINMA Art. 55 bis 60. Die FINMA stützt sich auf die Basler Rahmenvereinbarung, insbesondere auf MAR30-33.
1.1	IMA _{G,A} (MAR33.43)	IMA _{G,A} (MAR33.43)	Gesamte Eigenmittelanforderung für genehmigte und zugelassene (grüne und gelbe) Trading Desks, inkl. DRC und ohne den Kapitalzuschlag für gelbe Desks. Summe aus 1.1.1 und 1.1.2.
1.1.1	CA: Aggregate (non-DRC) capital requirement for those trading desks approved and eligible for the IMA (MAR33.41)	CA: Gesamte (nicht-DRC) Eigenmittelanforderung für die zugelassenen und für den Marktrisiko-Modellansatz in Frage kommenden Trading Desks (MAR33.41)	In die Berechnung dieser Position und aller Unterpositionen fließen nur Positionen von genehmigten und zugelassenen Trading Desks ein.
1.1.1.1	IMCC (0,5*Unconstrained ES+0,5*constrained risk class ES)	IMCC (0,5*uneingeschränkter ES + 0,5*eingeschränkter Risikoklassen ES)	Eigenmittelanforderung für modellierbare Risikofaktoren, MAR33.13-15.
1.1.1.1.1	Unconstrained expected shortfall	Unbeschränkter erwarteter Fehlbetrag	MAR33.13
1.1.1.1.2	Constrained expected shortfall	Eingeschränkter erwarteter Fehlbetrag	Summe der Positionen 1.1.1.1.2.1 bis 1.1.1.1.2.5, MAR33.14.
1.1.1.1.2.1	ES for general interest rate risk	ES für das allgemeine Zinsänderungsrisiko	
1.1.1.1.2.2	ES for equity risk	ES für Aktienpreisisiko	
1.1.1.1.2.3	ES for commodity risk	ES für das Rohstoffrisiko	
1.1.1.1.2.4	ES for foreign exchange risk	ES für das Fremdwährungsrisiko	
1.1.1.1.2.5	ES for credit spread risk	ES für Kreditspread-Risiko	
1.1.1.2	Capital requirement for non-modellable risk factors; Stressed Expected Shortfall (SES)	Eigenmittelanforderung für nicht modellierbare Risikofaktoren; Stressed Expected Shortfall (SES)	MAR33.16, 17
1.1.1.3	Multiplication factor	Multiplikationsfaktor	MAR33.42; der Multiplikationsfaktor wird auf die durchschnittliche Eigenmittelanforderung für modellierbare Risikofaktoren angewendet.
1.1.1.3.1	Number of backtesting exceptions	Anzahl der Backtesting-Ausnahmen	Backtesting-Ausnahmen erhöhen den Multiplikationsfaktor in Übereinstimmung mit MAR32.9.
1.1.2	Default risk capital (DRC) requirement (MAR33.22)	Anforderung an das Ausfallrisikokapital (DRC) (MAR33.22)	MAR33.18-39

1.1.2.1	Default risk capital requirement model measure	Modellmassnahme für die Eigenmittelanforderung für das Ausfallrisiko	
1.2	SA _{G,A} (MAR33.45)	SA _{G,A} (MAR33.45)	Eigenmittelbedarf bei Anwendung des Marktrisiko-Standardansatzes auf genehmigte und zulässige (grüne oder gelbe) Handelsabteilungen
1.3	Total SA Capital requirements for trading desks ineligible to use the IMA as reported in P_MKR_BIS_SA.MELD	Gesamte Marktrisiko-Standardansatz-Eigenmittelanforderungen für Handelsabteilungen, die nicht zur Nutzung des Marktrisiko-Modellansatz berechtigt sind, wie in P_MKR_BIS_SA.MELD gemeldet	MAR33.40
1.4	SA capital requirements for all trading desks (including those subject to IMA)	SA-Kapitalanforderungen für alle Handelsabteilungen (inklusive derjenigen, die im Anwendungsbereich des Marktrisiko-Modellansatz sind)	
1.5	Capital surcharge for amber trading desks	Eigenmittelaufschlag für orange Trading Desks	Der Zuschlag verwendet 1.1 und 1.2 als Eingaben; MAR33.45
1.5.1	k (MAR33.45)	k (MAR33.45)	
1.6	Capital requirements for green and amber trading desks (including capital surcharge)	Eigenmittelanforderungen für grüne und gelbe Trading Desks (inklusive Eigenmittelzuschlag)	Summe der Punkte 1.1 und 1.5.
1.7	Difference in capital requirements under the IMA and SA for green and amber trading desks	Unterschiedliche Eigenmittelanforderungen nach Marktrisiko-Modellansatz und Marktrisiko-Standardansatz für grüne und gelbe Trading Desks	Unterschied zwischen den Punkten 1.1 und 1.2.

Weitere Informationen finden Sie unter ...:

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

E_PC_MKR_IMA_Notes.fm/