

Sekretariat der
EIDGENÖSSISCHEN BANKENKOMMISSION
Abt. Banken / Effekthändler
Schwanengasse 12
Postfach
3001 Bern

SCHWEIZERISCHE NATIONALBANK
Statistische Erhebungen
Börsenstrasse 15
Postfach
8022 Zürich

Bern/Zürich, November 2004

Anomalien in den Zinsrisikomeldungen

Sehr geehrte Damen und Herren

Wir beziehen uns auf unsere Schreiben vom März 2002 und 5. Dezember 2003 und möchten zu den Formularen ZR001/101 und ZR002/102 einige weitere Präzisierungen anbringen.

In diesen Formularen können buchhaltungsmässig und/oder betriebstechnisch bedingte Abweichungen von der vorgesehenen Norm auftreten. Diese Abweichungen werden als **Anomalien** bezeichnet und bedürfen zwingend seitens der meldenden Institute erklärender Kommentare.

Letztere sind **neu** ausschliesslich

- entweder auf Formular ZR004, Kolonne 01, Zeile 05
- oder in einem separaten E-Mail zu Händen des Erhebungsverantwortlichen
(Jean-Jacques Grob, Tel.: 044/631'33'63, E-Mail: jean-jacques.grob@snb.ch)

zusammen mit der gesamten Zinsrisikomeldung einzureichen.

Für Ihre wertvolle Mitarbeit danken wir Ihnen bereits im Voraus.

Mit freundlichen Grüssen

Für das Sekretariat der
Eidg. Bankenkommission

für die Statistik der
Schweizerischen Nationalbank

K. Bucher
Vizedirektor

L. Lugano
Vizedirektor