



Eidgenössische Bankenkommision
Commission fédérale des banques
Commissione federale delle banche
Swiss Federal Banking Commission

Seminar „Basel II“

Schweizerische Umsetzung auf der Zielgeraden

Marktrisiken

Dr. Martin Sprenger

29. September 2005, Kongresszentrum, MCH Messe Basel



Wichtigste Neuerungen: **Basler** Teil

- **Spezifisches Risiko von Zinsinstrumenten** im Standardansatz: Anpassung an neue Kategorien (nach Emittententyp und Ratingklasse)
- Neue **Handelsbuchdefinition** (grundsätzlicher Ausschluss z.B. von Hedge-Funds)
- Möglichkeit zur **Modellierung von Ereignis- und Ausfallrisiken** (für Banken mit VaR-Modell)



Wichtigste Neuerungen: **Berner** Teil

- **Kreditderivate im Handelsbuch:** neu im Rundschreiben Marktrisiken (Rundschreiben Kreditderivate wird aufgehoben)
- Verrechnung des **allgemeinen Marktrisikos von Aktienpositionen:** innerhalb nationaler Aktienmärkte, aber nicht mehr innerhalb **einheitlicher Währungsräume**



Kontaktinformation

Dr. Martin Sprenger

Sekretariat der Eidg. Bankenkommission

Telefon: +41 (0)31 322 63 99

Telefax: +41 (0)31 322 69 26

E-Mail: martin.sprenger@ebk.admin.ch