

Zinsrisikomeldung per _____

Fragen zu den gemeldeten Daten und zum internen Risikomass

Bitte Ihren Code einsetzen

	Kol. 01
Messmethodik des internen Zinsrisikoindikators (Duration, VaR, etc.).....	

01

System mit welchem das Zinsrisiko gemessen wird.....	

02

Art der Behandlung der nichtlinearen Derivate im internen Zinsrisikoindikator (deltage-wichtete Positionen, Neubewertung, etc.)	

03

Wenn die Zinszahlungen der Kategorie I nicht gemeldet werden: kurze Begründung	

04

Weitere Abweichungen der Meldung gegenüber den gemäss Erläuterungen, Abschnitt 1 berücksichtigten Positionen	

05

Annnonce du risque de taux d'intérêt, au _____

Questions sur les données brutes et sur l'indicateur interne de risque de taux d'intérêt

Indiquez votre code s.v.p.

	col. 01
Méthode interne de mesure du risque de taux d'intérêt (duration, value at risk, etc.).....	

01

Nom du système de mesure du risque de taux d'intérêt	

02

Méthode de traitement des produits dérivés non linéaires dans l'indicateur interne de risque de taux d'intérêt (positions pondérées par le facteur delta, réévaluation, etc.)	

03

Lorsque les paiements d'intérêts de la catégorie I ne sont pas annoncés: brève justification	

04

Autres différences entre les données effectivement annoncées et les positions devant être prises en compte selon le point 1 des commentaires.....	

05