

Hilfsdokument Rundschreiben 2013/1 „Anrechenbare Eigenmittel – Banken“

**Reporting zu den nach *Fair Value* bewerteten Finanzinstrumen-
ten**

20. Juni 2018

POSITIONEN	Buchwert	Fair Value	Nominalwert des Instruments	Nominalwert vom Host
AKTIVEN				
Handelsbestand				
Derivative Finanzinstrumente				
Finanzinstrumente mit <i>Fair Value</i> über OCI				
a) Forderungstitel				
b) Beteiligungstitel				
c) Sonstige				
Finanzinstrumente ausserhalb des Handelsbestands mit <i>Fair Value</i> über Erfolgsrechnung				
a) Forderungstitel ohne eingebettete Derivate				
b) Forderungstitel mit eingebetteten Derivaten				
Finanzinstrumente mit Erfassung gemäss <i>Accrual</i> -Methode				
Weitere Aktiven				
TOTAL				
PASSIVEN				
Handelsbestand				
Derivative Finanzinstrumente				
Finanzverpflichtungen mit <i>Fair Value</i> über Erfolgsrechnung				
a) Finanzverpflichtungen ohne eingebettete Derivate				
b) Finanzverpflichtungen mit eingebetteten Derivaten				
Finanzverpflichtungen gemäss <i>Accrual</i> -Methode				
Weitere Verpflichtungen				
Eigenkapital				
davon <i>Cash flow hedge</i> -Reserve				
davon Reserve für eigene Kreditwürdigkeit				
davon Reserve für Finanzinstrumente mit <i>Fair Value</i> über OCI (<i>net of taxes</i>)				
TOTAL				