

Zinsrisikomeldung per _____

in 1'000 Schweizer Franken ¹

Währungscode gemäss ISO

Bitte Ihren Code einsetzen

	Kategorie I		Kategorie II				
	Forderungen	Verbindlichkeiten ²	Forderungen auf Sicht Kol. 03	Verbindlichkeiten auf Sicht Kol. 06	Forderungen gegenüber Kunden (Anteil mit unbestimmter Zinsbindung) Kol. 09	Hypothekarforderungen (Anteil mit unbestimmter Zinsbindung) Kol. 12	Spargelder Kol. 15
Nominalbetrag abzüglich eventuelle Wertberichtigungen.....	---	---	01	01	01	01	01
Methode für die Unterstellung der Zinsbindung ³	---	---	02	02	02	02	02

Zeitbänder	Cash-Flows	Cash-Flows	Gewicht in %	Cash-Flows	Gewicht in %	Cash-Flows	Gewicht in %	Cash-Flows	Gewicht in %	Cash-Flows	Gewicht in %	Cash-Flows
	Kol. 01	Kol. 02	Kol. 04	Kol. 05	Kol. 07	Kol. 08	Kol. 10	Kol. 11	Kol. 13	Kol. 14	Kol. 16	Kol. 17
bis 1 Tag	01	01		01		01		01		01		01
> 1 Tag bis 1 Monat	02	02		02		02		02		02		02
> 1 Monat bis 2 Monate	03	03		03		03		03		03		03
> 2 Monate bis 3 Monate	04	04		04		04		04		04		04
> 3 Monate bis 6 Monate	05	05		05		05		05		05		05
> 6 Monate bis 9 Monate	06	06		06		06		06		06		06
> 9 Monate bis 1 Jahr	07	07		07		07		07		07		07
> 1 Jahr bis 2 Jahre	08	08		08		08		08		08		08
> 2 Jahre bis 3 Jahre	09	09		09		09		09		09		09
> 3 Jahre bis 4 Jahre	10	10		10		10		10		10		10
> 4 Jahre bis 5 Jahre	11	11		11		11		11		11		11
> 5 Jahre bis 6 Jahre	12	12		12		12		12		12		12
> 6 Jahre bis 7 Jahre	13	13		13		13		13		13		13
> 7 Jahre bis 8 Jahre	14	14		14		14		14		14		14
> 8 Jahre bis 9 Jahre	15	15		15		15		15		15		15
> 9 Jahre bis 10 Jahre	16	16		16		16		16		16		16
> 10 Jahre bis 15 Jahre	17	17		17		17		17		17		17
> 15 Jahre	18	18		18		18		18		18		18

1) - Cash-Flows der Forderungen sind ohne Vorzeichen einzutragen, Cash-Flows der Verbindlichkeiten mit einem Minuszeichen.

- Für jede Kolonne muss die Summe der Gewichte +100% betragen.

2) Exklusive Dotationskapital und als Eigenmittel angerechnete nachrangige Anleihen.

3) Methode für Unterstellung der Zinsbindung: 0 = aufgrund von Annahmen, 1 = statistischer Ansatz, 2 = keine Unterstellung der Zinsbindung

Annnonce du risque de taux d'intérêt, au _____

en milliers de francs suisses ¹

Code de monnaie selon ISO

Indiquez votre code s.v.p.

	Catégorie I		Catégorie II				
	Créances	Engagements ²	Créances à vue col. 03	Engagements à vue col. 06	Créances sur la clientèle (partie avec contrainte indéterminée de taux) col. 09	Créances hypothécaires (partie avec contrainte indéterminée de taux) col. 12	Fonds d'épargne col. 15
Montant nominal après déduction des éventuels correctifs de valeurs	---	---	01	01	01	01	01
Méthode utilisée pour la détermination de la contrainte de taux ³	---	---	02	02	02	02	02

Fourchettes de temps	Cash-flows col. 01	Cash-flows col. 02	Poids en % col. 04	Cash-flows col. 05	Poids en % col. 07	Cash-flows col. 08	Poids en % col. 10	Cash-flows col. 11	Poids en % col. 13	Cash-flows col. 14	Poids en % col. 16	Cash-flows col. 17
jusqu'à 1 jour	01	01		01		01		01		01		01
> 1 jour et jusqu'à 1 mois.....	02	02		02		02		02		02		02
> 1 mois et jusqu'à 2 mois.....	03	03		03		03		03		03		03
> 2 mois et jusqu'à 3 mois.....	04	04		04		04		04		04		04
> 3 mois et jusqu'à 6 mois.....	05	05		05		05		05		05		05
> 6 mois et jusqu'à 9 mois.....	06	06		06		06		06		06		06
> 9 mois et jusqu'à 1 an.....	07	07		07		07		07		07		07
> 1 an et jusqu'à 2 ans.....	08	08		08		08		08		08		08
> 2 ans et jusqu'à 3 ans.....	09	09		09		09		09		09		09
> 3 ans et jusqu'à 4 ans.....	10	10		10		10		10		10		10
> 4 ans et jusqu'à 5 ans.....	11	11		11		11		11		11		11
> 5 ans et jusqu'à 6 ans.....	12	12		12		12		12		12		12
> 6 ans et jusqu'à 7 ans.....	13	13		13		13		13		13		13
> 7 ans et jusqu'à 8 ans.....	14	14		14		14		14		14		14
> 8 ans et jusqu'à 9 ans.....	15	15		15		15		15		15		15
> 9 ans et jusqu'à 10 ans.....	16	16		16		16		16		16		16
> 10 ans et jusqu'à 15 ans.....	17	17		17		17		17		17		17
> 15 ans	18	18		18		18		18		18		18

1) - Les cash-flows liés aux créances sont indiqués sans signe, les cash-flows liés aux engagements avec un signe „ moins“.

- Pour chaque colonne, la somme des poids doit être égale à +100%.

2) Excepté le capital de dotation et les emprunts de rang subordonné comptés dans les fonds propres.

3) Méthode utilisée pour la détermination de la contrainte de taux: 0 = sur la base d'une hypothèse, 1 = approche statistique, 2 = pas d'hypothèse sur la contrainte de taux

Zinsrisikomeldung per _____

in 1'000 Schweizer Franken ¹

Währungscode gemäss ISO

Bitte Ihren Code einsetzen

Kategorie III						
	Handelsbestand abzüglich Wertschriften-Shortpositionen Kol. 18	Finanzanlagen (ohne Zinsbindung oder mit arbiträrer Zinsbindung) Kol. 21	Beteiligungen Kol. 24	Sachanlagen Kol. 27	Sonstige Aktiven Kol. 30	Sonstige Passiven und Rück- stellungen (sofern nicht in Kat. I berücksichtigt), die nicht als Eigenmittel angerechnet werden Kol. 33
Nominalbetrag abzüglich eventuelle Wertberichtigungen.....	01	01	01	01	01	01
Methode für die Unterstellung der Zinsbindung ²	02	02	02	02	02	02

Zeitbänder	Gewicht in % Kol. 19	Cash-Flows Kol. 20	Gewicht in % Kol. 22	Cash-Flows Kol. 23	Gewicht in % Kol. 25	Cash-Flows Kol. 26	Gewicht in % Kol. 28	Cash-Flows Kol. 29	Gewicht in % Kol. 31	Cash-Flows Kol. 32	Gewicht in % Kol. 34	Cash-Flows Kol. 35
	bis 1 Tag		01		01		01		01		01	
> 1 Tag bis 1 Monat		02		02		02		02		02		02
> 1 Monat bis 2 Monate		03		03		03		03		03		03
> 2 Monate bis 3 Monate		04		04		04		04		04		04
> 3 Monate bis 6 Monate		05		05		05		05		05		05
> 6 Monate bis 9 Monate		06		06		06		06		06		06
> 9 Monate bis 1 Jahr		07		07		07		07		07		07
> 1 Jahr bis 2 Jahre		08		08		08		08		08		08
> 2 Jahre bis 3 Jahre		09		09		09		09		09		09
> 3 Jahre bis 4 Jahre		10		10		10		10		10		10
> 4 Jahre bis 5 Jahre		11		11		11		11		11		11
> 5 Jahre bis 6 Jahre		12		12		12		12		12		12
> 6 Jahre bis 7 Jahre		13		13		13		13		13		13
> 7 Jahre bis 8 Jahre		14		14		14		14		14		14
> 8 Jahre bis 9 Jahre		15		15		15		15		15		15
> 9 Jahre bis 10 Jahre		16		16		16		16		16		16
> 10 Jahre bis 15 Jahre		17		17		17		17		17		17
> 15 Jahre		18		18		18		18		18		18

1) - Cash-Flows der Forderungen sind ohne Vorzeichen einzutragen, Cash-Flows der Verbindlichkeiten mit einem Minuszeichen.

- Für jede Kolonne muss die Summe der Gewichte +100% betragen.

2) Methode für Unterstellung der Zinsbindung: 0 = aufgrund von Annahmen, 1 = statistischer Ansatz, 2 = keine Unterstellung der Zinsbindung, 3 = effektive Zinsbindung.

Annnonce du risque de taux d'intérêt, au _____

en milliers de francs suisses ¹

Code de monnaie selon ISO

Indiquez votre code s.v.p.

Catégorie III						
	Portefeuille de négoce, après déduction des titres-positions courtes col. 18	Immobilisations financières (partie sans contrainte de taux ou avec contrainte arbitraire de taux) col. 21	Participations col. 24	Immobilisations corporelles col. 27	Autres actifs col. 30	Autres passifs et provisions non comptées dans les fonds propres (sauf la partie éventuell. prise en compte dans la cat. I) col. 33
Montant nominal après déduction des éventuels correctifs de valeurs	01	01	01	01	01	01
Méthode utilisée pour la détermination de la contrainte de taux ²	02	02	02	02	02	02

Fourchettes de temps	Poids en % col. 19	Cash-flows col. 20	Poids en % col. 22	Cash-flows col. 23	Poids en % col. 25	Cash-flows col. 26	Poids en % col. 28	Cash-flows col. 29	Poids en % col. 31	Cash-flows col. 32	Poids en % col. 34	Cash-flows col. 35
jusqu'à 1 jour		01		01		01		01		01		01
> 1 jour et jusqu'à 1 mois.....		02		02		02		02		02		02
> 1 mois et jusqu'à 2 mois.....		03		03		03		03		03		03
> 2 mois et jusqu'à 3 mois.....		04		04		04		04		04		04
> 3 mois et jusqu'à 6 mois.....		05		05		05		05		05		05
> 6 mois et jusqu'à 9 mois.....		06		06		06		06		06		06
> 9 mois et jusqu'à 1 an.....		07		07		07		07		07		07
> 1 an et jusqu'à 2 ans.....		08		08		08		08		08		08
> 2 ans et jusqu'à 3 ans.....		09		09		09		09		09		09
> 3 ans et jusqu'à 4 ans.....		10		10		10		10		10		10
> 4 ans et jusqu'à 5 ans.....		11		11		11		11		11		11
> 5 ans et jusqu'à 6 ans.....		12		12		12		12		12		12
> 6 ans et jusqu'à 7 ans.....		13		13		13		13		13		13
> 7 ans et jusqu'à 8 ans.....		14		14		14		14		14		14
> 8 ans et jusqu'à 9 ans.....		15		15		15		15		15		15
> 9 ans et jusqu'à 10 ans.....		16		16		16		16		16		16
> 10 ans et jusqu'à 15 ans.....		17		17		17		17		17		17
> 15 ans		18		18		18		18		18		18

1) - Les cash-flows liés aux créances sont indiqués sans signe, les cash-flows liés aux engagements avec un signe „ moins“.
 - Pour chaque colonne, la somme des poids doit être égale à +100%.

2) Méthode utilisée pour la détermination de la contrainte de taux: 0 = sur la base d'une hypothèse, 1 = approche statistique, 2 = pas d'hypothèse sur la contrainte de taux, 3 = contrainte de taux effective.

Zinsrisikomeldung per _____

in 1'000 Schweizer Franken ¹

Währungscode gemäss ISO

Bitte Ihren Code einsetzen

	Kategorie IV			Kategorie V
	Anrechenbare Eigenmittel	davon: Dotationskapital	davon: als Eigenmittel angerechnete nachrangige Anleihen	Kontraktvolumen von nicht- linearen Derivaten auf Zins- instrumente im Bankenbuch
	Kol. 36	Kol. 39	Kol. 42	Kol. 45
Nominalbetrag abzüglich eventuelle Werberichtigungen	01	01	01	01
Methode für die Unterstellung der Zinsbindung ²	02	02	02	— 02

Zeitbänder	Gewicht in %	Cash-Flows	Gewicht in %	Cash-Flows	Gewicht in %	Cash-Flows
	Kol. 37	Kol. 38	Kol. 40	Kol. 41	Kol. 43	Kol. 44
bis 1 Tag		01		01		01
> 1 Tag bis 1 Monat		02		02		02
> 1 Monat bis 2 Monate		03		03		03
> 2 Monate bis 3 Monate		04		04		04
> 3 Monate bis 6 Monate		05		05		05
> 6 Monate bis 9 Monate		06		06		06
> 9 Monate bis 1 Jahr		07		07		07
> 1 Jahr bis 2 Jahre		08		08		08
> 2 Jahre bis 3 Jahre		09		09		09
> 3 Jahre bis 4 Jahre		10		10		10
> 4 Jahre bis 5 Jahre		11		11		11
> 5 Jahre bis 6 Jahre		12		12		12
> 6 Jahre bis 7 Jahre		13		13		13
> 7 Jahre bis 8 Jahre		14		14		14
> 8 Jahre bis 9 Jahre		15		15		15
> 9 Jahre bis 10 Jahre		16		16		16
> 10 Jahre bis 15 Jahre		17		17		17
> 15 Jahre		18		18		18

1) - Cash-Flows der Forderungen sind ohne Vorzeichen einzutragen, Cash-Flows der Verbindlichkeiten mit einem Minuszeichen.

- Für jede Kolonne muss die Summe der Gewichte +100% betragen.

2) Methode für Unterstellung der Zinsbindung: 0 = aufgrund von Annahmen, 1 = statistischer Ansatz, 2 = keine Unterstellung der Zinsbindung, 3 = effektive Zinsbindung.

Annnonce du risque de taux d'intérêt, au _____

en milliers de francs suisses ¹

Code de monnaie selon ISO

Indiquez votre code s.v.p.

	Catégorie IV			Catégorie V
	Fonds propres pouvant être pris en compte col. 36	dont: Capital de dotation col. 39	dont: Emprunts de rang subordonné pris en compte dans les fonds propres col. 42	Montant du sous-jacent des produits dérivés non linéaires sur des instruments de taux d'intérêt du portefeuille de banque col. 45
Montant nominal après déduction des éventuels correctifs de valeurs	01	01	01	01
Méthode utilisée pour la détermination de la contrainte de taux ²	02	02	02	02

Fourchettes de temps	Poids en % col. 37	Cash-flows col. 38	Poids en % col. 40	Cash-flows col. 41	Poids en % col. 43	Cash-flows col. 44
jusqu'à 1 jour		01		01		01
> 1 jour et jusqu'à 1 mois.....		02		02		02
> 1 mois et jusqu'à 2 mois.....		03		03		03
> 2 mois et jusqu'à 3 mois.....		04		04		04
> 3 mois et jusqu'à 6 mois.....		05		05		05
> 6 mois et jusqu'à 9 mois.....		06		06		06
> 9 mois et jusqu'à 1 an.....		07		07		07
> 1 an et jusqu'à 2 ans.....		08		08		08
> 2 ans et jusqu'à 3 ans.....		09		09		09
> 3 ans et jusqu'à 4 ans.....		10		10		10
> 4 ans et jusqu'à 5 ans.....		11		11		11
> 5 ans et jusqu'à 6 ans.....		12		12		12
> 6 ans et jusqu'à 7 ans.....		13		13		13
> 7 ans et jusqu'à 8 ans.....		14		14		14
> 8 ans et jusqu'à 9 ans.....		15		15		15
> 9 ans et jusqu'à 10 ans.....		16		16		16
> 10 ans et jusqu'à 15 ans.....		17		17		17
> 15 ans		18		18		18

1) - Les cash-flows liés aux créances sont indiqués sans signe, les cash-flows liés aux engagements avec un signe „ moins“.

- Pour chaque colonne, la somme des poids doit être égale à +100%.

2) Méthode utilisée pour la détermination de la contrainte de taux: 0 = sur la base d'une hypothèse, 1 = approche statistique, 2 = pas d'hypothèse sur la contrainte de taux, 3 = contrainte de taux effective.