

**Zinsrisikomeldung per \_\_\_\_\_**  
 Fragen zu den gemeldeten Daten und zum internen Risikomass

Bitte Ihren Code einsetzen

	Ja = 1 Nein = 0
	Kol. 01
Der interne Zinsrisikoindikator berücksichtigt die Positionen der folgenden Kategorien:	
- Kategorie I (Positionen mit bestimmter Zinsbindung) .....	01
- Kategorie II (Positionen mit unbestimmter Zinsbindung) .....	02
- Kategorie III (Positionen ohne Zinsbindung oder mit arbiträrer Zinsbindung) .....	03
- Kategorie IV (Replikation der Eigenmittel) .....	04
- Als Eigenmittel angerechnete nachrangigen Anleihen .....	05
- Dotationskapital .....	06
- Kategorie V (nichtlineare Derivate) .....	07
Cash-Flows der Kategorie I enthalten	
- Prinzipal- und Zinszahlungen .....	08
- Nur Prinzipalzahlungen .....	09
Die Cash-Flows oder die Gewichte der Kategorien II - IV werden anhand einer Replikation mit Tranchen bestimmt .....	10
Die Bank setzt lineare Derivate (Swaps, FRA's, etc.) im Bankenbuch ein .....	11
Die Bank setzt nichtlineare Derivate (Swaptions, Caps, etc.) im Bankenbuch ein .....	12
Die gemeldeten Cash-Flows berücksichtigen nichtlineare Derivate .....	13
Behandlung der nichtlinearen Derivate in der Meldung erfolgt mittels deltagewichteten Positionen .....	14
Der interne Zinsrisikoindikator berücksichtigt implizite Optionen (z.B. Kündigungsrechte) .....	15
Die gemeldeten Cash-Flows berücksichtigen implizite Optionen .....	16
Kategorie I enthält Zinspositionen aus dem Handelsbuch (internes Risikomass und gemeldete Cash-Flows) .....	17
Struktureffekte (Veränderungen der Volumen) werden im internen Risikomass berücksichtigt .....	18
Bei VaR: Konfidenzniveau (in Prozent) .....	19
Bei VaR: Halteperiode (in Tagen) .....	20

# 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.

	Oui = 1 Non = 0
	col. 01
L'indicateur interne de risque de taux d'intérêt prend en compte les positions des catégories suivantes:	
- Catégorie I (positions avec contrainte déterminée de taux d'intérêt).....	01
- Catégorie II (positions avec contrainte indéterminée de taux d'intérêt).....	02
- Catégorie III (positions sans contrainte de taux d'intérêt ou avec contrainte arbitraire de taux d'intérêt) .....	03
- Catégorie IV (réplication des fonds propres) .....	04
- Emprunts de rang subordonné pris en compte dans les fonds propres .....	05
- Capital de dotation .....	06
- Catégorie V (produits dérivés non linéaires) .....	07
Les cash-flows de la catégorie I contiennent:	
- le paiement du principal et le paiement des intérêts.....	08
- seulement le paiement du principal .....	09
Les cash-flows ou les poids des catégories II à IV sont déterminés à l'aide de la méthode de " réplication par tranches " .....	10
La banque utilise des produits dérivés linéaires (swaps, FRAs, etc.) dans le portefeuille de banque .....	11
La banque utilise des produits dérivés non linéaires (swaptions, caps, etc.) dans le portefeuille de banque .....	12
Les cash-flows indiqués prennent en compte les produits dérivés non linéaires .....	13
Les produits dérivés non linéaires sont indiqués à l'aide de la méthode des positions pondérées par le facteur delta.....	14
L'indicateur interne de risque de taux d'intérêt prend en compte les options implicites (par exemple, les droits de dénonciation du contrat).....	15
Les cash-flows indiqués prennent en compte les options implicites .....	16
La catégorie I contient des positions sur taux d'intérêt du portefeuille de négoce (indicateur interne de risque et cash-flows) .....	17
L'indicateur interne de risque prend en compte les effets de structure (variations des volumes).....	18
Pour la value at risk: intervalle de confiance (en %) .....	19
Pour la value at risk: période de détention (en jours).....	20