

63. Marktrisikomeldung Währungsgesamtposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

MKR QFW

Übergeordnetes Unternehmen: _____

Stand Ende: _____

Institutsnummer: _____ Prüfziffer: ____ Instituts-/Finanzholding-Gruppe: _____

Ort: _____

- in Mio Euro -

Positionen		Insgesamt	USD	GBP	CHF	JPY	CAD	Übrige	Gold
		(Spalte 02 bis 07)	02	03	04	05	06	Fremdwährungen	08
		01						07	
Aktivpositionen									
1. Bilanzielle Vermögensgegenstände einschl. zeitanteiliger Erträge	010								
2. Liefer- und Zahlungsansprüche aus Kassageschäften	020								
sonstige Derivate ohne Optionsrechte der Positionen 3 und 4	030								
Ansprüche auf Zahlung von Kapitalbeträgen aus Finanz-Swaps	040								
3. Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zustehende Liefer- oder Zahlungsansprüche aus Devisen- oder Goldoptionen	050								
4. Sonstige eigene Optionsrechte	060								
5. Sonstige Aktivpositionen	070								
Aktivpositionen insgesamt	100								
Passivpositionen									
1. Bilanzielle Schulden einschließlich zeitanteiliger Aufwendungen	110								
2. Liefer- und Zahlungsverpflichtungen aus Kassageschäften	120								
sonstige Derivate ohne Optionsrechte der Positionen 3 und 4	130								
Verpflichtungen zur Zahlung von Kapitalbeträgen aus Finanz-Swaps	140								
3. Als Optionsberechtigter/Stillhalter zu erfüllende Liefer- oder Zahlungsverpfl. aus Devisen- oder Goldoptionen	150								
4. Sonstige fremde Optionsrechte	160								
5. Sonstige Passivpositionen	170								
Passivpositionen insgesamt	200								
Offene	210	+	+	+	+	+	+	+	+
Einzelwährungsposition	220
Nettowährungsposition (der größere Betrag - ohne Vorzeichen - der Zeilen 210/01 oder 220/01)	230								
abzüglich 50 % der ausgeglichenen Währungsposition in eng verbundenen Währungen	240	.							
zuzüglich offene Goldposition (Betrag der Zeile 230/08)	250	+							
zuzüglich des Anrechnungsbetrages für Investmentanteile nach § 294 Abs. 6 Satz 6 SolvV	255	+							
Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV	260	+							
Nettoabgrenzungsbetrag für zeitant. Erträge/Aufwendungen (nur für Institute, bei denen die Abgrenzung nicht pro Fremdwährung verfügbar ist)	270	+							
Währungsgesamtposition (Summe der Zeilen 230 bis 270)	280								

Offene Goldposition

x 8,0 %

99001
Anrechnungsbetrag für Währungsgesamtposition

Nachrichtlich:

Strukturelle Währungspositionen nach § 4 Abs. 4 SolvV	99002	
Abzugsposten in Fremdwährung nach § 4 Abs. 4 SolvV	99003	