

# 64. Marktrisikomeldung Rohwarenposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

**MKR QRW**

Übergeordnetes Unternehmen: \_\_\_\_\_

Stand Ende: \_\_\_\_\_

Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüfziffer: \_\_\_\_\_ Instituts-/ Finanzholding-Gruppe: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_

- in Mio Euro -

Positionen		Insgesamt	Öle, Petroleum und Gas	Landwirtschaftl. Erzeugnisse	Metalle	Übrige Rohwaren
		01	02	03	04	05
<b>Aktivpositionen</b>						
1. Unter Aktiva der Bilanz auszuweisende Rohwarenbestände	010					
2. Lieferansprüche aus						
Kassageschäften	020					
Termingeschäften	030					
Swappeschäften	040					
3. Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zustehende Lieferansprüche	050					
4. Eventualanprüche auf Rückgabe von in Pension gegebenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	060					
<b>Aktivpositionen insgesamt</b>		100				
<b>Passivpositionen</b>						
1. Lieferverpflichtungen aus						
Kassageschäften	110					
Termingeschäften	120					
Swappeschäften	130					
2. Als Optionsberechtigter/Stillhalter zu erfüllende Lieferverpflichtungen	140					
3. Eventualverbindlichkeiten auf Rückgabe von in Pension genommenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	150					
<b>Passivpositionen insgesamt</b>		200				

## I. Vereinfachtes Verfahren

		01	02	03
Summe der Aktiv- und Passivpositionen	210		x 3,0 %	
Summe der offenen Rohwareneinzelpositionen	220		x 15,0 %	
	230	<b>Summe A</b>		

## II. Zeitfächermethode

		01	02	03
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen nach § 297 Abs. 2 Satz 3 SolvV	300		X 0%	
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen vor und nach der Verrechnung zwischen den Zeitfächern	310		x 3,0 %	
Summe der offenen Bereichspositionen nach Verrechnung	320		x 0,6 %	
Verbleibende offene Bereichsposition	330		x 15,0 %	
	340	<b>Summe B</b>		
	350	<b>Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV</b>		
	360	<b>Anrechnungsbetrag für Rohwarenposition (Zeile 230+340+350)</b>		