

Anl. 2 4. DeRiMV Duration-Netting

4. DeRiMV - 4. Derivate-Risikoberechnungs- und Meldeverordnung

⌚ Berücksichtigter Stand der Gesetzgebung: 13.08.2026

Zuordnung jedes Zinsderivats zu der entsprechenden Bandbreite („Bucket“) der nachfolgend angeführten Laufzeittabelle:

Bucket	Laufzeit
1	0-2 Jahre
2	2-7 Jahre
3	7-15 Jahre
4	>15 Jahre

Die Berechnung des gleichwertigen Basiswerts des Zinsderivats erfolgt durch das Dividieren der Duration des Zinsderivats durch die Ziel-Duration des OGAW (unter üblichen Marktbedingungen) multipliziert mit dem Marktwert des Basiswerts:

Die Zusammenrechnung der gleichwertigen Long- und Short-Basiswertpositionen innerhalb der jeweiligen Bandbreite („Bucket“), ergibt die genetete Position für den jeweiligen „Bucket“.

Zusammenrechnung der übrigen nicht geneteten Long- (oder Short-) Positionen“ in „Bucket“ (i) mit den übrigen Short- (Long-) Positionen in „Bucket“ (i+1).

Zusammenrechnung der übrigen nicht geneteten Long- (oder Short-) Positionen“ in „Bucket“ (i) mit den übrigen Short- (Long-) Positionen in „Bucket“ (i+2).

Berechnung der geneteten Summe zwischen den Positionen (Long und Short) der zwei entferntesten Buckets.

Der OGAW berechnet sein Gesamtrisiko aus der Summe aus:

1. 1.

In Kraft seit 01.09.2011 bis 31.12.9999