



Zinsrisiken: quantitative Informationen zur Positionsstruktur und Zinsneufestsetzung (IRRBBA1)

		Volumen in CHF Mio.			Durchschnittliche Zinsneufestsetzungsfrist (in Jahren)		Maximale Zinsneufestsetzungsfrist (in Jahren) für Positionen mit modellierter (nicht deterministischer) Bestimmung des Zinsneufestsetzungsdatums	
		Total	Davon CHF	Davon andere wesentliche Währungen, die mehr als 10 % der Vermögenswerte oder Verpflichtungen der Bilanzsumme ausmachen	Total	Davon CHF	Total	Davon CHF
Bestimmtes Zinsneufestsetzungsdatum	Forderungen gegenüber Banken	-	-	-	-	-		
	Forderungen gegenüber Kunden	1	1	-	2.44	2.44		
	Geldmarkthypotheken	-	-	-	-	-		
	Festhypotheken	179	179	-	3.29	3.29		
	Finanzanlagen	44	44	-	3.85	3.85		
	Übrige Forderungen	-	-	-	-	-		
	Forderungen aus Zinsderivaten	-	-	-	-	-		
	Verpflichtungen gegenüber Banken	-	-	-	-	-		
	Verpflichtungen aus Kundeneinlagen	-1	-1	-	0.38	0.38		
	Kassenobligationen	-30	-30	-	3.52	3.52		
	Anleihen und Pfandbriefdarlehen	-15	-15	-	5.40	5.40		
	Übrige Verpflichtungen	-	-	-	-	-		
Verpflichtungen aus Zinsderivaten	-	-	-	-	-			
Unbestimmtes Zinsneufestsetzungsdatum	Forderungen gegenüber Banken	8	8	-	0.03	0.03		
	Forderungen gegenüber Kunden	10	10	-	0.23	0.23		
	Variable Hypothekarforderungen	22	22	-	1.34	1.34		
	Übrige Forderungen auf Sicht	-	-	-	-	-		
	Verpflichtungen auf Sicht in Privatkonti und Kontokorrentkonti	-67	-67	-	1.16	1.16		
	Übrige Verpflichtungen auf Sicht	-	-	-	-	-		
	Verpflichtungen aus Kundeneinlagen, kündbar aber nicht übertragbar (Spargelder)	-128	-128	-	2.17	2.17		
	Total	235	235	-	1.65	1.65	10	10



Zinsrisiken: quantitative Informationen zum Barwert und Zinsertrag (IRRBB1)

In CHF	Δ EVE (Änderung des Barwerts)	Δ NII (Änderung des Ertragswerts)
Periode	30.06.2019	30.06.2019
Parallelverschiebung nach oben	-4'073'406	-39'305
Parallelverschiebung nach unten	4'507'992	-112'190
Steepener-Schock ¹	-1'356'351	
Flattener-Schock ²	560'387	
Anstieg kurzfristiger Zinsen	-937'300	
Sinken kurzfristiger Zinsen	973'988	
Maximum	-4'073'406	-112'190
Periode	30.06.2019	
Kernkapital (Tier 1)	34'039'021	

¹ Sinken der kurzfristigen Zinsen in Kombination mit Anstieg der langfristigen Zinsen.

² Anstieg der kurzfristigen Zinsen in Kombination mit Sinken der langfristigen Zinsen.

Da die geforderten Angaben erstmals gemeldet werden, sind keine Abweichung zum Vorjahr verfügbar.