

Zusätzliche Formalprüfungen bei Anwendung der "Prudential Filter" unter Berücksichtigung der Portfolioeffekte nach § 2 KonÜV

Wenn Pos. 026001 > 0 und Pos. 030001 < 0 bzw. vice versa ist,
dann sind die üblichen Plausibilitäten zu Pos. 025001, 027001, 031001, 059001 und 060001 außer Kraft gesetzt und die Berechnungsmethodik folgt ausschließlich den nachfolgend aufgeführten Plausibilitäten:

Da die Korrekturposten in Pos. 027001 und 031001 bei dieser Berechnungsmethodik nicht erforderlich sind, ist in diesen Fällen **Pos. 027001 = 0 und Pos. 031001 = 0**

1. Fall: Pos. 026001 > 0 und Pos. 030001 < 0

a) Wenn Pos. 026001 + Pos. 030001 > 0

dann ist

Pos. 059001 =
(Pos. 026001 + Pos.030001)* max 45%

UND

Pos. 025001 = 036001+ 037001 + 038001 + 039001

UND

Wert in Pos. 025001 < = 0

UND

Wert in Pos. 027001 = 0 und Pos. 031001 = 0

b) Wenn Pos. 026001 + Pos. 030001 <= 0

dann ist

Pos. 059001 = 0

UND

Pos. 025001 = Pos. 026001 + 030001 + 036001+ 037001 + 038001 + 039001

UND

Wert in Pos. 025001 < = 0

UND

Wert in Pos. 027001 = 0 und Pos. 031001 = 0

2. Fall: Pos. 026001 < 0 und Pos. 030001 > 0

a) Wenn Pos. 030001 + Pos. 026001 > 0

dann ist

Pos. 060001 =

$(\text{Pos. 030001} + \text{Pos. 026001}) * \text{max } 45\%$

UND

Pos. 025001 = 036001 + 037001 + 038001 + 039001

UND

Wert in Pos. 025001 ≤ 0

UND

Wert in Pos. 027001 = 0 und Pos. 031001 = 0

b) Wenn Pos. 030001 + Pos. 026001 ≤ 0

dann ist

Pos. 060001 = 0

UND

Pos. 025001 =

$\text{Pos. 026001} + \text{030001} + \text{036001} + \text{037001} + \text{038001} + \text{039001}$

UND

Wert in Pos. 025001 ≤ 0

UND

Wert in Pos. 027001 = 0 und Pos. 031001 = 0