

Das Credit Spread Risiko wird anhand der Credit Spreads vom Geschäftsabschlußtag und vom aktuellen Buchungstag ermittelt. Die Credit Spreads werden dabei den Zinssätzen bei der Ermittlung der Diskontfaktoren zugeschlagen. Die Zinssätze werden dabei immer vom Buchungstag verwendet, so dass die Differenz dieser so ermittelten Diskontfaktoren das Credit Spread Risiko widerspiegelt. Die mit diesen Diskontfaktoren abdiskontierten Cashflows werden dabei pro Zeitraum einer frei definierbaren Zeitraumstaffel angezeigt. Das kumulierte Credit Spread Risiko wird dann als Summe pro Zeitraum ermittelt.