Anlage A1

Ordnungsnormenausweis für Kreditinstitute gemäß § 1 ONA-V

Kapitel "Kapitaladäquanzblatt (CA-TEMPLATE)" gemäß § 22 BWG Eigenmittelerfordernis und § 23 BWG Eigenmittel
--

Periodizität: Monatlich/Jährlich (13. Meldung - geprüft)

CA-TEMPLATE unkonsolidiert

		Betrag
1	Eigenmittel insgesamt	7800000
1.1	Kernkapital	7810000
1.1.1	Zwischensumme Kapitalia	7811000
1.1.1***	Hievon: Instrumente, die Stammaktien gleichzustellen sind	7811002
1.1.1****	Hievon: Instrumente, die Vorzugsrechte im Bereich der Dividendenzahlungen auf nicht kumulativer Basis enthalten	7811004
1.1.1.1	Eingezahltes Kapital (Geschäfts-, Grund-, Stamm-, Dotationskapital und Geschäftsguthaben) ohne Vorzugsaktien mit Dividendennachzahlungspflicht	7811006
1.1.1.2	(-) Eigene Aktien oder Geschäftsanteile	7811008
1.1.1.3	Kapitalrücklage (Emissionsagiokonto)	7811010
1.1.1.4	Sonstige als eingezahltes Kapital anrechenbare Instrumente (z.B. unbefristete stille Beteiligungen)	7811012
1.1.2	Sonstige anrechenbare Rücklagen	7812000
1.1.2*	Hievon: Haftrücklage	7812003
1.1.2.1	Sonstige Rücklagen	7812006
1.1.2.2	Minderheitsbeteiligungen	7812009
1.1.2.2***01	Hievon: in Krisenzeiten wandlungspflichtiges Hybridkapital	7812011
1.1.2.2***02	Hievon: Hybridkapital (unbefristet, ohne Erhöhungsvereinbarung)	7812012
1.1.2.2***03	Hievon: Hybridkapital (befristet oder mit Erhöhungsvereinbarung)	7812015
1.1.2.2***04	Hievon: begrenzt anrechenbares Hybridkapital ohne Erhöhungsvereinbarung - Grandfathering	7812016
1.1.2.2***05	Hievon: begrenzt anrechenbares Hybridkapital mit Erhöhungsvereinbarung - Grandfathering	7812017
1.1.2.3	Zwischengewinn	7812018
1.1.2.4	(-) Bilanzverlust sowie materielle negative Ergebnisse im laufenden Geschäftsjahr	7812021
1.1.2.5	(-) Nettogewinne aus der Kapitalisierung künftiger Erträge verbriefter Forderungen	7812024
1.1.2.6	Im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften (Prudential Filters)	7812027
1.1.2.6.01	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten	7812030
1.1.2.6.02	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten	7812033
1.1.2.6.03	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Krediten und sonstigen Forderungen	7812036
1.1.2.6.04	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Krediten und sonstigen Forderungen	7812039
1.1.2.6.05	Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögensgegenständen	7812042
1.1.2.6.06	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögensgegenständen	7812045
1.1.2.6.07	Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf Finanzinstrumente (eigenes Kreditrisiko)	7812048
1.1.2.6.08	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf Finanzinstrumente (eigenes Kreditrisiko)	7812051
1.1.2.6.09	Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögensgegenständen dienen	7812054
1.1.2.6.10	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögensgegenständen dienen	7812057
1.1.2.6.11	Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien	7812060
1.1.2.6.12	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien	7812063
1.1.2.6.13	Bewertungseffekte aus selbstgenutztem Anlagevermögen	7812066
1.1.2.6.14	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbstgenutztem Anlagevermögen	7812069
1.1.2.6.15	Andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen	7812072
1.1.2.6.16	Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen	7812075
1.1.2.6.17	+/- Unterschiedsbetrag aus der Zusammenfassung von Eigenkapital und Beteiligungen	7812078
1.1.2.6.18	+/- Umrechnungsdifferenzen ausländischer Währungen	7812081
1.1.2.6.19	+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung der nachgeordneten Institute	7812084
1.1.2.6.20	+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung von Beteiligungen an Unternehmen	7812087
1.1.3	Fonds für allgemeine Bankrisiken	7813000
1.1.4	Andere, landesspezifische Kernkapitalbestandteile	7814000

1.1.4.1a	<i>Hybridkapital</i>	7814002
1.1.4.1a.01	<i>in Krisenzeiten wandlungspflichtiges Hybridkapital</i>	7814010
1.1.4.1a.02	<i>Hybridkapital (unbefristet, ohne Erhöhungsvereinbarung)</i>	7814011
1.1.4.1a.03	<i>Hybridkapital (befristet oder mit Erhöhungsvereinbarung)</i>	7814012
1.1.4.1a.04	<i>begrenzt anrechenbares Hybridkapital ohne Erhöhungsvereinbarung - Grandfathering</i>	7814013
1.1.4.1a.05	<i>begrenzt anrechenbares Hybridkapital mit Erhöhungsvereinbarung - Grandfathering</i>	7814014
1.1.4.3	<i>Korrekturposten (positiv) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften</i>	7814006
1.1.4.4	<i>Sonstige Korrekturposten (positiv)</i>	7814008
1.1.5	(-) Sonstige Abzugspositionen vom Kernkapital	7815000
1.1.5.1	<i>(-) Immaterielle Vermögensgegenstände</i>	7815002
1.1.5.2a	<i>(-) Abzugsposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 3a BWG</i>	7815003
1.1.5.2a.01	<i>(-) Abzugsposten für alle Hybridkapitalia (mit Ausnahme von Grandfathering)</i>	7815004
1.1.5.2a.02	<i>(-) Abzugsposten für Hybridkapital (mit Ausnahme von in Krisenzeiten wandlungspflichtigem Hybridkapital)</i>	7815005
1.1.5.2a.03	<i>(-) Abzugsposten für Hybridkapital (befristet oder mit Erhöhungsvereinbarung)</i>	7815006
1.1.5.2a.04	<i>(-) Abzugsposten für Hybridkapital (aufgrund von Grandfathering)</i>	7815007
1.1.5.3a	<i>(-) Zusätzlicher Abzugsposten aufgrund Fair-Value-Bewertung</i>	7815015
1.1.5.4	<i>(-) Andere, landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital</i>	7815008
1.1.5.4.1	<i>(-) Korrekturposten (negativ) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften</i>	7815010
1.1.5.4.2	<i>(-) Sonstige Korrekturposten (negativ)</i>	7815012
1.2	<i>Ergänzende Eigenmittel</i>	7820000
1.2.1	<i>Zwischensumme I</i>	7821000
1.2.1.1	<i>Als ergänzende Eigenmittel anrechenbare Kernkapitalbestandteile</i>	7821005
1.2.1.2	<i>Korrekturposten für aus dem Kernkapital übertragene Bewertungseffekte (Prudential Filters)</i>	7821010
1.2.1.2.01	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten</i>	7821015
1.2.1.2.02	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Vermögensgegenständen umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821020
1.2.1.2.03	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821025
1.2.1.2.04	<i>Korrekturposten aus selbstgenutztem Anlagevermögen umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821030
1.2.1.2.05	<i>Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen</i>	7821035
1.2.1.3	<i>Anrechenbare nicht realisierte Reserven in Grundstücken, grundstückgleichen Rechten und Gebäuden sowie in notierten Wertpapieren in Verbundunternehmen und Gebäuden (Neubewertungsreserve)</i>	7821040
1.2.1.4	<i>Sonstige ergänzende Eigenmittelkomponenten/Ergänzungskapital gemäß § 23 Abs. 1 Z 5 BWG</i>	7821045
1.2.1.5	<i>Berücksichtigungsfähiger Risikovorsorgeüberschuss für IRB-Positionen</i>	7821050
1.2.1.6	<i>Landesspezifische ergänzende Eigenmittelbestandteile höherer Qualität</i>	7821055
1.2.1.6.1	<i>Stille Reserven</i>	7821060
1.2.1.6.2	<i>Partizipationskapital mit Dividendennachzahlungspflicht</i>	7821065
1.2.1.7	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 4 BWG</i>	7821070
1.2.2	<i>Zwischensumme II</i>	7822000
1.2.2.1	<i>Haftsummenzuschläge</i>	7822005
1.2.2.2	<i>Kumulative Vorzugsaktien mit fester Laufzeit</i>	7822010
1.2.2.3	<i>Langfristiges nachrangiges Kapital</i>	7822015
1.2.2.4	<i>Landesspezifische ergänzende Eigenmittelbestandteile niedriger Qualität</i>	7822020
1.2.2.5	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 3 BWG</i>	7822025
1.2.2.6	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 6 BWG</i>	7822030
1.2.3	<i>(-) Abzugspositionen von der Summe der ergänzenden Eigenmittel</i>	7823000
1.2.3.1	<i>(-) Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 2 BWG</i>	7823005
1.2.3.2	<i>(-) Andere, landesspezifische Abzugspositionen von der Summe der ergänzenden Eigenmittel</i>	7823010
1.3	<i>(-) Abzugspositionen vom Kernkapital und von ergänzenden Eigenmittel</i>	7830000
1.3.T1*	<i>Hievon: (-) vom Kernkapital</i>	7830002
1.3.T2*	<i>Hievon: (-) von ergänzenden Eigenmittel</i>	7830004
1.3.1	<i>(-) Anteile an anderen Kredit- und Finanzinstituten von mehr als 10% ihres Kapitals</i>	7830006
1.3.2	<i>(-) Nachrangige Forderungen, Partizipationskapital, Ergänzungskapital oder sonstige Kapitalformen, die das Kreditinstitut an anderen Kredit- und Finanzinstituten hält, an deren Kapital es zu jeweils mehr als 10% beteiligt ist</i>	7830008
1.3.3	<i>(-) Kapitalbestandteile an anderen als unter 1.3.1 und 1.3.2 genannten Kredit- und Finanzinstituten</i>	7830010

	von höchstens 10% ihres Kapitals, sofern diese zusammengenommen mehr als 10% der Eigenmittel des Kreditinstitutes übersteigen	
1.3.4	(-) Beteiligungen an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften (im Falle der Inanspruchnahme der Übergangsbestimmung § 103e Z 13 BWG bis zum 31.12.2012 nicht zu befüllen)	7830012
1.3.5	(-) Sonstige Kapitalbestandteile an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften (im Falle der Inanspruchnahme der Übergangsbestimmung § 103e Z 13 BWG bis zum 31.12.2012 nicht zu befüllen)	7830014
1.3.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital und von ergänzenden Eigenmittel	7830016
1.3.7	(-) Verbriefungspositionen, auf die ein Risikogewicht von 1250% angewandt wird und die bei der Ermittlung der risikogewichteten Aktiva oder in der Nettoposition nicht berücksichtigt worden sind	7830018
1.3.8	(-) Risikovorsorge-Fehlbeträge für IRB-Positionen	7830020
1.4	Anrechenbares Kernkapital (nach Abzugsposten)	7810001
1.5	Anrechenbare ergänzende Eigenmittel (nach Abzugsposten)	7830001
1.6	Anrechenbares Kernkapital und anrechenbare ergänzende Eigenmittel (nach Abzugsposten)	7850001
1.7	Abzugsposten bei Inanspruchnahme von § 103e Z 13 BWG	7861000
1.7.1	(-) Beteiligungen an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften gemäß § 103e Z 13 BWG	7861005
1.7.2	(-) Sonstige Kapitalbestandteile an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften gemäß § 103e Z 13 BWG	7861010
1.8	Anrechenbares Kernkapital und anrechenbare ergänzende Eigenmittel (nach allen Abzugsposten)	7860001
1.9	Tier III-Kapital	7840000
1.9.1	Zur Umwidmung in Tier III-Kapital zur Verfügung stehendes Tier II-Kapital	7840005
1.9.2	Nettogewinn aus dem Handelsbuch	7840010
1.9.3	Kurzfristiges nachrangiges Kapital	7840015
1.9.4	(-) Illiquide Aktiva	7840020
1.9.5	Korrekturposten (200%-Grenze vom freien Kernkapital gemäß § 23 Abs. 14 Z 7 BWG)	7840025
1.9.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Tier III-Kapital	7840030
1.9.7	(-) Ungenutztes, aber anrechenbares Tier III-Kapital	7840035
1.10	ZUSATZINFORMATIONEN:	
1.10.1	Auf interne Ratings basierender Ansatz-Risikovorsorgen Überschuss (+)/Fehlbetrag (-)	7850015
1.10.1.1	<i>Höhe der IRB-Risikovorsorgen</i>	7850020
1.10.1.1*	<i>Hievon: Pauschalwertberichtigungen</i>	7850025
1.10.1.1**	<i>Einzelwertberichtigungen</i>	7850030
1.10.1.1***	<i>Rückstellungen</i>	7850035
1.10.1.2	<i>(-) IRB-Ermittlung des erwarteten Verlustes</i>	7850040
1.10.2	Vorhandene Nachrangkapitalia gemäß § 23 Abs. 14 Z 5 BWG	7850045
1.11	Wert des Fondsvermögens gemäß § 3 Abs. 4 BWG	7850050
1.12	Eigenmittel-Basis für Großveranlagungen gemäß § 27 BWG	7850055
2	Gesamteigenmittelerfordernis	7700000
2.1	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Kreditrisiko gemäß §§ 22a bis 22h BWG	7710000
2.1*	Hievon: Kontrahentenausfallsrisiko aus dem Handelsbuch	7710001
2.1.1	Standardansatz (SA)	7711000
2.1.1.1a	Standardansatz-Forderungsklassen (ohne Berücksichtigung von Verbriefungspositionen)	7711003
2.1.1.1a.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7711006
2.1.1.1a.02	Forderungen an regionale Gebietskörperschaften	7711009
2.1.1.1a.03	Forderungen an Verwaltungseinrichtungen und Unternehmen ohne Erwerbscharakter im Besitz von Gebietskörperschaften	7711012
2.1.1.1a.04	Forderungen an multilaterale Entwicklungsbanken	7711015
2.1.1.1a.05	Forderungen an internationale Organisationen	7711018
2.1.1.1a.06	Forderungen an Institute	7711021
2.1.1.1a.07	Forderungen an Unternehmen	7711024
2.1.1.1a.08	Retail-Forderungen	7711027
2.1.1.1a.09	Durch Immobilien besicherte Forderungen	7711030
2.1.1.1a.10	Überfällige Forderungen	7711033
2.1.1.1a.11	Forderungen mit hohem Risiko	7711036
2.1.1.1a.12	Forderungen in Form von gedeckten Schuldverschreibungen	7711039
2.1.1.1a.13	Kurzfristige Forderungen an Institute und Unternehmen	7711042
2.1.1.1a.14	Forderungen in Form von Investmentfondsanteilen	7711045
2.1.1.1a.15	Sonstige Posten	7711048

2.1.1.2	<i>Verbriefungspositionen - Standardansatz</i>	7711060
2.1.1.2*	Hievon: Wiederverbriefungspositionen	7711062
2.1.2	Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRB)	7712000
2.1.2.1	<i>Auf interne Ratings basierender Ansatz - ohne eigene LGD-Schätzung/Anwendung von Umrechnungsfaktoren</i>	7712005
2.1.2.1.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7712010
2.1.2.1.02	Forderungen an Institute	7712015
2.1.2.1.03	Forderungen an Unternehmen	7712020
2.1.2.2	IRB-Ansatz - mit eigener LGD-Schätzung/Anwendung von Umrechnungsfaktoren	7712025
2.1.2.2.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7712030
2.1.2.2.02	Forderungen an Institute	7712035
2.1.2.2.03	Forderungen an Unternehmen	7712040
2.1.2.2.04	Retail-Forderungen	7712045
2.1.2.3	Beteiligungspositionen IRB	7712050
2.1.2.4	Verbriefungspositionen IRB	7712055
2.1.2.4*	Hievon: Wiederverbriefungspositionen	7712057
2.1.2.5	Sonstige Forderungen	7712060
2.2	Abwicklungsrisiko	7720000
2.2.1	Bankbuch	7720001
2.2.2	Handelsbuch	7720002
2.3	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko	7730000
2.3.1	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko (Standardansatz)	7731000
2.3.1.a	Hievon: nicht-lineare Risiken	7731005
2.3.1.b	Hievon: Szenario-Matrixmethode gemäß § 22o Abs. 2 Z 8 BWG	7731010
2.3.1.1	Positionsrisiko in Schuldtiteln	7731015
2.3.1.1.01	<i>Allgemeines und spezifisches Risiko aus MKR SA TDI</i>	7731016
2.3.1.1.02	<i>Spezifisches Risiko aus Verbriefungspositionen</i>	7731017
2.3.1.1.03	<i>Spezifisches Risiko aus Correlation Trading Portfolio</i>	7731018
2.3.1.2	Positionsrisiko in Substanzwerte	7731020
2.3.1.3	Risiko in Fremdwährungspositionen	7731025
2.3.1.4	Risiko in Warenpositionen	7731030
2.3.2	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko (Internes Modell)	7732000
2.4	EIGENMITTELERFORDERNIS für Operationelles Risiko	7740000
2.4.1	Operationelles Risiko Basisindikatoransatz	7741000
2.4.2	Operationelles Risiko Standardansatz/Alternativer Standardansatz	7742000
2.4.3	Operationelles Risiko Fortgeschrittener Messansatz	7743000
2.5	EIGENMITTELERFORDERNISSE resultierend aus dem Umstieg auf Basel II-Bestimmungen und sonstige Eigenmittelerfordernisse	7750000
2.5.1	Erfordernis aus Mindesteigenmitteluntergrenze aus dem Umstieg auf Basel II (Floor)	7751000
2.5.2	Eigenmittelerfordernis für qualifizierte Nichtfinanzbeteiligungen	7751005
2.5.3	Zusätzliches Eigenmittelerfordernis gemäß § 3 Abs. 4 BWG – (nur von KAG zu melden)	7751010
2.5.4.	Gesamteigenmittelerfordernis bei Anwendung von § 103e Z 7 BWG im Rahmen des Roll-out gemäß 21a Abs. 7 BWG	7751015
3	ZUSATZINFORMATIONEN:	
3.1	Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln (vor Berücksichtigung sonstiger Eigenmittelerfordernisse resultierend aus dem Umstieg auf die Basel II-Bestimmungen)	7610000
3.1.a	Capital ratio (in %); (vor Berücksichtigung sonstiger Eigenmittelerfordernisse resultierend aus dem Umstieg auf die Basel II-Bestimmungen)	7610005
3.2	Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln	7620000
3.2.a	Capital ratio (in %)	7620005
3.3	Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln unter Berücksichtigung des aufsichtlichen Überprüfungsprozesses	7630000
3.3.a	Capital index ratio (in %) unter Berücksichtigung des aufsichtlichen Überprüfungsprozesses	7630005
3.4	Interne Bewertung Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln	7640000
3.4.1	Interne Bewertung der anrechenbaren Eigenmittel	7641000
3.4.2	Interne Bewertung des Eigenmittelerfordernisses	7642000

EIGENMITTELVERWENDUNGSRECHNUNG

Eigenmittelkategorien	Freies Kapital (abzüglich Eigenmittelerfordernisse gemäß § 22 Abs. 1 Z 1 BWG, § 29 Abs. 4 BWG und § 3 Abs. 4 BWG)	Freies Kapital nach Operationellem Risiko	Freies Kapital nach Abdeckung sämtlicher Eigenmittelerfordernisse
Kernkapital (Tier I-Kapital)	7951001	7961001	7971001
Ergänzende Eigenmittel (Tier II-Kapital)	7955001	7965001	7975001
Kurzfristiges nachrangiges Kapital (Tier III-Kapital)			
Summe	7950000	7960000	7970000

Zusatzinformationen zu § 22 BWG

Risikogewichtete Aktiva	7980000
Risikogewichtete außerbilanzmäßige Geschäfte gemäß Anlage 1	7981000
Risikogewichtete Derivate gemäß Anlage 2	7982000
Risiko aus Investmentfondsanteilen gemäß § 22o Abs. 2 Z 6 BWG	7990000

Kapitel "Kreditrisiko-Standardansatz"

Periodizität: Vierteljährlich

KREDITRISIKO STANDARDANSATZ

TEIL A

SA Forderungsklasse:

< ... >

	Bruttoforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsfaktoren		Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nettoforderung	Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten						Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditrisikomindernde Techniken
	1	2			Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen (Ga)		Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen		Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken		
					Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten	Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen	Abflüsse (-)	Zuflüsse (+)	
11=4-9+10											
Summe Forderungen	7701000	7702000	7703000	7704000	7705000	7706000	7707000	7708000	7709000	7710000	7712001
Aufgliederung der Summenposition nach Forderungskategorien											
Bilanzielle Forderungen	7701005										
Außerbilanzielle Forderungen	7701010										
Lombardgeschäfte und Geschäfte mit langer Abwicklungsfrist	7701015										
Derivate	7701020										
Produktübergreifende Netting-Vereinbarung	7701025										
Aufgliederung der Summenposition nach Risikogewichten											
0%	7701030		7703030	7704030							
10%	7701035		7703035	7704035							
20%	7701040		7703040	7704040							
35%	7701045		7703045	7704045							
50%	7701050		7703050	7704050							
<i>ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur</i>											
<i>hypothekarisch besichert (Gewerbliche Immobilien)</i>	7701060		7703060	7704060							
70%											
75%	7701065		7703065	7704065							
100%	7701070		7703070	7704070							
<i>ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur</i>											
<i>hypothekarisch besichert (Gewerbliche Immobilien)</i>	7701080		7703080	7704080							
150%	7701085		7703085	7704085							
200%	7701089		7703089	7704089							
Andere Risikogewichte nach nationalem Ermessen	7701095		7703095	7704095							

KREDITRISIKO STANDARDANSATZ

TEIL B

Kreditrisikomindernde Techniken in Form von Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen, ausgenommen andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen; Finanzielle Sicherheiten bei Anwendung der umfassenden Methode			Angepasster Wert der Forderung (E*)	Aufgliederung des vollständig angepassten Forderungswertes bei außerbilanziellen Geschäften durch Umrechnungsfaktoren (Credit Conversion Factors; CF)				Forderungswert	Risikogewichteter Forderungswert	Eigenmittelerfordernis
Volatilitätsanpassung des Forderungswertes (He)	Angepasster Wert der finanziellen Sicherheit (Cvam) (-)	Volatilitäts- und Laufzeitanpassungen (-)		0%	20%	50%	100%			
12	13	14	15 =11+12-13	16	17	18	19	20= 15 -16-0,8*17-0,5*18	21	22
7713000	7714000	7715000	7716000	7717000	7718000	7719000	7724000	7721000	7722000	7711003
								7721005	7722005	
								7721010	7722010	
								7721015	7722015	
								7721020	7722020	
								7721025	7722025	
			7716030					7721030	7722030	7711030
			7716035					7721035	7722035	7711035
			7716040					7721040	7722040	7711040
			7716045					7721045	7722045	7711045
			7716050					7721050	7722050	7711050
			7716060					7721060	7722060	7711061
			7716063					7721063	7722063	7711063
			7716065					7721065	7722065	7711065
			7716070					7721070	7722070	7711070
			7716080					7721080	7722080	7711080
			7716085					7721085	7722085	7711085
			7716089					7721089	7722089	7711089
			7716095					7721095	7722095	7711095

KREDITRISIKO STANDARDANSATZ (für Melde-KI, die unter dem Schwellenwert liegen)¹

TEIL A

SA Forderungsklasse:

< ... >

	Bruttoforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsfaktoren		Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nettoforderung	Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten						Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditrisikomindernde Techniken	
	1	2			3	Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen (Ga)		Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen		Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken		
						Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten	Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen	Abflüsse (-)		Zuflüsse (+)
	1	2	3	4=1-3	5	6	7	8	9	10	11=4-9+10	
Summe Forderungen	7701000	7702000	7703000	7704000	7705000	7706000	7707000	7708000	7709000	7710000	7712001	
Aufgliederung der Summenposition nach Forderungskategorien												
Bilanzielle Forderungen	7701005											
Außerbilanzielle Forderungen	7701010											
Lombardgeschäfte und Geschäfte mit langer Abwicklungsfrist	7701015											
Derivate	7701020											
Produktübergreifende Netting-Vereinbarung	7701025											
Aufgliederung der Summenposition nach Risikogewichten												
0%	7701030											
10%	7701035											
20%	7701040											
35%	7701045											
50%	7701050											
<i>ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur</i>												
<i>hypothekarisch besichert (Gewerbliche Immobilien)</i>	7701060											
70%												
75%	7701065											
100%	7701070											
<i>ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur</i>												
<i>hypothekarisch besichert (Gewerbliche Immobilien)</i>	7701080											
150%	7701085											
200%	7701089											
Andere Risikogewichte nach nationalem Ermessen	7701095											

¹ Wenden Kreditinstitute und Kreditinstitutsgruppen den Kreditrisiko-Standardansatz an und liegt ihre Bilanzsumme im geprüften Jahresabschluss des auf die Meldung vorangegangenen Geschäftsjahr unter dem Betrag von 250 Millionen Euro, haben diese Kreditinstitute obige Meldeinhalte zu übermitteln

KREDITRISIKO STANDARDANSATZ (für Melde-KI, die unter dem Schwellenwert liegen)¹

TEIL B

Kreditrisikomindernde Techniken in Form von Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen, ausgenommen andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen; Finanzielle Sicherheiten bei Anwendung der umfassenden Methode			Angepasster Wert der Forderung (E*)	Aufgliederung des vollständig angepassten Forderungswertes bei außerbilanziellen Geschäften durch Umrechnungsfaktoren (Credit Conversion Factors; CF)				Forderungswert	Risikogewichteter Forderungswert	Eigenmittelerfordernis
Volatilitätsanpassung des Forderungswertes (He)	Angepasster Wert der finanziellen Sicherheit (Cvam) (-)	Volatilitäts- und Laufzeitanpassungen (-)		0%	20%	50%	100%			
12	13	14	15 =11+12-13	16	17	18	19	20 = 15-16-0,8*17-0,5*18	21	22
7713000	7714000	7715000	7716000	7717000	7718000	7719000	7724000	7721000	7722000	7711003
								7721005	7722005	
								7721010	7722010	
								7721015	7722015	
								7721020	7722020	
								7721025	7722025	
								7721030		
								7721035		
								7721040		
								7721045		
								7721050		
								7721060		
								7721063		
								7721065		
								7721070		
								7721080		
7721085										
7721089										
7721095										

¹ Wenden Kreditinstitute und Kreditinstitutgruppen den Kreditrisiko-Standardansatz an und liegt ihre Bilanzsumme im geprüften Jahresabschluss des auf die Meldung vorangegangenen Geschäftsjahr unter dem Betrag von 250 Millionen Euro, haben diese Kreditinstitute obige Meldeinhalte zu übermitteln.

KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN STANDARDANSATZ

TEIL A

VERBRIEFUNGSTYP:

SUMME/TRADITIONELL/SYNETHISCH

<... >

	Summe der verbrieften Forderungen (originatorseitig)	Synthetische Verbriefungen: Besicherung der verbrieften Forderung			Verbriefungspositionen	Wertberichtigungen und Rückstellungen	Forderungen nach Abzug von Wertberichtigungen und Rückstellungen	Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten							
		Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen (Cva) (-)	Summe Abflüsse (-)					Nominalbetrag der zurückbehaltenen/ zurückgekauften Kreditbesicherung	Ursprüngliche Forderung vor Anwendung der Umrechnungsfaktoren	Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen (Ga)-Angepasster Wert	Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen	Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken			
			Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen - Angepasster Wert (Ga)									Summe Abflüsse (-)	Summe Zuflüsse (+)		
1	2	3	4	5	6	7=5-6	8	9	10	11					
Summe Forderungen	7100100	7100200	7100300	7100400	7100500	7100600	7100700	7100800	7100900	7101000	7101100				
Hievon: Wiederverbriefung	7100102	7100202	7100302	7100402	7100502	7100602	7100702	7100802	7100902	7101002	7101102				
Originator: Summe Forderungen	7100105	7100205	7100305	7100405	7100505	7100605	7100705	7100805	7100905	7101005	7101105				
Bilanzielle Forderungen	7100110	7100210	7100310	7100410	7100510	7100610	7100710								
Verbriefung	7100111	7100211	7100311	7100411	7100511	7100611	7100711								
Wiederverbriefung	7100112	7100212	7100312	7100412	7100512	7100612	7100712								
Außerbilanzielle Forderungen und Derivate	7100130	7100230	7100330	7100430	7100530	7100630	7100730								
Verbriefung	7100131	7100231	7100331	7100431	7100531	7100631	7100731								
Wiederverbriefung	7100132	7100232	7100332	7100432	7100532	7100632	7100732								
Klausel über vorzeitige Rückzahlung	7100133	7100233	7100333	7100433	7100533	7100633	7100733								
Investor: Summe Forderungen					7100535	7100635	7100735					7100835	7100935	7101035	7101135
<small>Hievon: Investorpositionen gegenüber Originatoren und Sponsoren, welche nicht unter die Regelungen des Art. 122a der Richtlinie 2009/111/EG fallen</small>					7100537										
Bilanzielle Forderungen					7100540	7100640	7100740								
Verbriefung					7100541	7100641	7100741								
Wiederverbriefung					7100542	7100642	7100742								
Außerbilanzielle Forderungen und Derivate					7100560	7100660	7100760								
Verbriefung					7100561	7100661	7100761								
Wiederverbriefung					7100562	7100662	7100762								
Sponsor: Summe Forderungen					7100565	7100665	7100765	7100865	7100965	7101065	7101165				
Bilanzielle Forderungen					7100570	7100670	7100770								
Außerbilanzielle Forderungen und Derivate					7100575	7100675	7100775								

KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN STANDARDANSATZ

TEIL B

Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditrisikomindernde Techniken	Kreditrisikomindernde Techniken in Form von Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen, ausgenommen andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen; Finanzielle Sicherheiten bei Anwendung der umfassenden Methode (CVAM) (-)	Vollständig angepasster Forderungswert (E*)	Aufgliederung des vollständig angepassten Forderungswertes (E*) bei außerbilanziellen Geschäften durch Umrechnungsfaktoren				Forderungswert	Abzug von den Eigenmitteln (-)	Zuordnung von Risikogewichten
			0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%			
12	13	14	15	16	17	18	19	20	21=19-20
7101200	7101300	7101400	7101500	7101600	7101700	7101800	7101900	7102000	7102100
7101202	7101302	7101402	7101502	7101602	7101702	7101802	7101902	7102002	7102102
7101205	7101305	7101405	7101505	7101605	7101705	7101805	7101905	7102005	7102105
		7101410					7101910	7102010	7102110
		7101411					7101911	7102011	7102111
		7101412					7101912	7102012	7102112
		7101430					7101930	7102030	7102130
		7101431					7101931	7102031	7102131
		7101414					7101932	7102032	7102132
		7101433					7101933	7102033	7102133
7101235	7101335	7101435	7101535	7101635	7101735	7101835	7101935	7102035	7102135
		7101440					7101940	7102040	7102140
		7101441					7101941	7102041	7102141
		7101442					7101942	7102042	7102142
		7101460	7101560	7101660	7101760	7101860	7101960	7102060	7102160
		7101461	7101561	7101661	7101761	7101861	7101961	7102061	7102161
		7101462	7101562	7101662	7101762	7101862	7101962	7102062	7102162
7101265	7101365	7101465	7101565	7101665	7101765	7101865	7101965	7102065	7102165
		7101470					7101970	7102070	7102170
		7101475	7101575	7101675	7101775	7101875	7101975	7102075	7102175

KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN STANDARDANSATZ

TEIL C

Aufschlüsselung der Verbriefungspositionen gemäß Risikogewichten											Risikogewichtete Forderungsposition	Gesamteffekt (Anpassung) auf die risikogewichtete Forderungsposition auf Grund von Verstößen gegen die Sorgfaltspflicht	Gesamteffekt (Anpassung) auf die risikogewichtete Forderungsposition auf Grund von Laufzeitinkongruenzen	Eigenmittel-erfordernis vor "CAP"	Zusatzangabe: Kapitalerfordernis entsprechend den Abflüssen von der SA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Eigenmittel-erfordernis nach "CAP"
Mit Rating (Bonitätsstufe 1 bis 4)							1250%		Transparenzmethode							
20%	40%	50%	100%	225%	350%	650%	Mit Rating	Ohne Rating	Hievon: "second loss position" in ABCP (asset backed commercial paper)							
22	22b	23	24	24b	25	25b	26	27	28	29	30	30a	30b	31	32	33
7102200	7103400	7102300	7102400	7103500	7102500	7103600	7102600	7102700	7102800	7102900	7103000	7103300	7103700	7103100	7103200	7711060
	7103402		7102402	7103502		7103602	7102602	7102702	7102802	7102902	7103002	7103302	7103702	7103102	7103202	7711062
7102205	7103405	7102305	7102405	7103505	7102505	7103605	7102605	7102705	7102805	7102905	7103005	7103305	7103705	7103105		
7102210	7103410	7102310	7102410	7103510	7102510	7103610	7102610	7102710	7102810	7102910	7103010			7103110		
7102211		7102311	7102411		7102511		7102611	7102711	7102811	7102911	7103011			7103111		
	7103412		7102412	7103512		7103612	7102612	7102712	7102812	7102912	7103012			7103112		
7102230	7103430	7102330	7102430	7103530	7102530	7103630	7102630	7102730	7102830	7102930	7103030			7103130		
7102231		7102331	7102431		7102531		7102631	7102731	7102831	7102931	7103031			7103131		
	7103432		7102432	7103532		7103632	7102632	7102732	7102832	7102932	7103032			7103132		
7102233	7103433	7102333	7102433	7103533	7102533	7103633	7102633	7102733	7102833	7102933	7103033			7103133		
7102235	7103435	7102335	7102435	7103535	7102535	7103635	7102635	7102735	7102835	7102935	7103035	7103335	7103735	7103135		
7102240	7103440	7102340	7102440	7103540	7102540	7103640	7102640	7102740	7102840	7102940	7103040	7103340	7103740	7103140		
7102241		7102341	7102441		7102541		7102641	7102741	7102841	7102941	7103041	7103341	7103741	7103141		
	7103442		7102442	7103542		7103642	7102642	7102742	7102842	7102942	7103042	7103342	7103742	7103142		
7102260	7103460	7102360	7102460	7103560	7102560	7103660	7102660	7102760	7102860	7102960	7103060	7103360	7103760	7103160		
7102261		7102361	7102461		7102561		7102661	7102761	7102861	7102961	7103061	7103361	7103761	7103161		
	7103462		7102462	7103562		7103662	7102662	7102762	7102862	7102962	7103062	7103362	7103762	7103162		
7102265	7103465	7102365	7102465	7103565	7102565	7103665	7102665	7102765	7102865	7102965	7103065	7103365	7103765	7103165		
7102270	7103470	7102370	7102470	7103570	7102570	7103670	7102670	7102770	7102870	7102970	7103070			7103170		
7102275	7103475	7102375	7102475	7103575	7102575	7103675	7102675	7102775	7102875	7102975	7103075			7103175		

Kapitel "Kreditrisiko - Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRB)"

Periodizität: Vierteljährlich

KREDITRISIKO AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ

TEIL A

IRB Forderungsklasse:

< ... >

	Ratingstufe <...>	Internes Rating System			Bruttoforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsfaktoren	Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten					
		(PD)-Bandbreite		Ausfallswahrscheinlichkeit aufgrund Bonitätseinstufung (%)		Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen		Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen	Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von		
		Untere PD-Grenze in %	Obere PD-Grenze in %			Garantien	Kreditderivate		Abflüsse (-)	Zuflüsse (+)	
		1	2								3
1. Summe Forderungen					8004000	8005000	8006000	8007000	8008000	8009000	8010000
Aufgliederung der Summenposition nach Forderungskategorien											
Bilanzielle Forderungen					8004005						
Außerbilanzielle Forderungen					8004010						
Lombardgeschäfte und Geschäfte mit langer Abwicklungsfrist					8004015						
Derivate					8004020						
Produktübergreifende Netting-Vereinbarung					8004025						
1.1 Summenposition nach Ratingstufen			8003030	8004030			8006030	8007030	8008030	8009030	8010030
Aufgliederung der Summenposition nach Ratingstufe											
Ratingstufe (a):1	<...>										
2		8001035	8002035	8003035	8004035						
.....											
N											
1.2 Projektfinanzierung Slotting Ansatz (b): Summe						8004040					
Aufgliederung der Summenposition "Projektfinanzierung" nach Risikogewichten											
Risikogewicht: 0%					8004045						
50%					8004050						
70%					8004055						
Hievon: nach Kategorie 1					8004060						
90%					8004065						
115%					8004070						
250%					8004075						
1.3 Alternative Anwendung: hypothekarisch besichert					8004080						
1.4 Forderungen, Vorleistungen risikogewichtet nach der alternativen Anwendung oder mit 100%											
1.5 Verwässerungsrisiko: Summe der Forderungskäufe					8004085						

(a) Anordnung von der niedrigsten zur höchsten durchschnittlichen Ausfallswahrscheinlichkeit gemäß Ratingstufe. Die Ausfallswahrscheinlichkeit im Falle eines Ausfalls beträgt 100%. Forderungskategorien nach der alternativen Anwendung von hypothekarischer Besicherung ist nur erlaubt, wenn es keine eigene LGD-Schätzung gibt.

(b) Diese Zeilen stehen für die Forderungsklassen "Projektfinanzierung", "Unternehmen" und für die "Summe Forderungen" zur Verfügung.

KREDITRISIKO AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ

TEIL B

Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditrisikomindernde Techniken	Forderungswert nach CCF	Kreditrisikomindernde Techniken berücksichtigt in LGD-Schätzungen exklusive Behandlung von Doppelausfall							Behandlung von Doppelausfall
		Verwendung eigener LGD-Schätzungen: Sicherheiten mit Sicherheitsleistung		Berücksichtigung von Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen					Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen
		Garantien	Kreditderivate	Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen	Bankfähige finanzielle Sicherheiten	Andere bankfähige Sicherheiten			
<i>Hypothekarische Sicherheiten</i>	<i>Andere physische Sicherheiten</i>					<i>Forderungen</i>			
11=(4-9+10)	12	13	14	15	16	17	18	19	20
8011000	8012000	8013000	8014000	8015000	8016000	8017000			
	8012005								
	8012010								
	8012015								
	8012020								
	8012025								
8011030	8012030	8013030	8014030	8015030	8016030	8017030			
8011035	8012035								
8011040	8012040								
8011080	8012080								

(a) Anordnung von der niedrigsten zur höchsten durchschnittlichen Ausfallswahrscheinlichkeit gemäß Ratingstufe. Die Ausfallswahrscheinlichkeit im Falle eines Ausfalls beträgt 100%. Forderungskategorien nach der alternativen Anwendung von hypothekarischer Besicherung ist nur erlaubt, wenn es keine eigene LGD-Schätzung gibt.

(b) Diese Zeilen stehen für die Forderungsklassen "Projektfinanzierung", "Unternehmen" und für die "Summe Forderungen" zur Verfügung.

KREDITRISIKO AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ

TEIL C

Forderungsgewichtete durchschnittliche Verlustquote bei Ausfall (LGD) in %	Forderungsgewichtete durchschnittliche effektive Restlaufzeit in (Tagen)	Risikogewichteter Forderungswert	Eigenmittel-erfordernis	Zusatzinformationen		
				Erwarteter Verlust	Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kontrahenten
21	22	23	24	25	26	27
8021000	8022000	8023000	7712000	8025000	8026000	8027000
		8023005				
		8023010				
		8023015				
		8023020				
		8023025				
8021030	8022030	8023030	8024030	8025030	8026030	8027030
8021035	8022035	8023035	8024035			8027035
		8023040	8024040	8025040	8026040	
		8023045	8024045			
		8023050	8024050			
		8023055	8024055			
		8023060	8024060			
		8023065	8024065			
		8023070	8024070			
		8023075	8024075			
		8023080	8024080		8026080	
			8024085			

(a) Anordnung von der niedrigsten zur höchsten durchschnittlichen Ausfallswahrscheinlichkeit gemäß Ratingstufe. Die Ausfallswahrscheinlichkeit im Falle eines Ausfalls beträgt 100%. Forderungskategorien nach der alternativen Anwendung von hypothekarischer Besicherung ist nur erlaubt, wenn es keine eigene LGD-Schätzung gibt.

(b) Diese Zeilen stehen für die Forderungsklassen "Projektfinanzierung", "Unternehmen" und für die "Summe Forderungen" zur Verfügung.

KREDITRISIKO BETEILIGUNGEN AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ

TEIL A

	"Ratingstufe" <...>	Internes Ratingsystem			Bruttoforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsfaktoren	Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten			
		(PD)-Bandbreite		Ausfallswahrscheinlichkeit aufgrund Bonitätseinstufung (%)		Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen		Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken	
		Untere PD-Grenze in %	Obere PD-Grenze in %			Garantien	Kreditderivate	Abflüsse (-)	Zuflüsse (+)
		1	2	3		4	5	6	7
Summe IRB-Forderungskategorie Beteiligungen									
1. PD/LGD-Ansatz: Summe									
				8504005	8505005	8506005	8507005	8508005	
Aufgliederung der Summenposition gemäß PD/LGD-Ansatz nach Ratingstufe									
Ratingstufe (a): 1	<...>	8501010	8502010	8503010	8504010				
2									
....									
N									
2. Einfacher risikogewichteter Ansatz: Summe									
				8504015	8505015	8506015	8507015	8508015	
Aufgliederung der Summenposition gemäß dem einfachen risikogewichteten Ansatz nach Risikogewichten									
Risikogewicht: 190%				8504020					
290%				8504025					
370%				8504030					
3. Ansatz nach internem Modell									
4. Grandfathering									
				8504040					

(a) Anordnung von der niedrigsten zur höchsten durchschnittlichen Ausfallswahrscheinlichkeit gemäß Ratingstufe. Die Ausfallswahrscheinlichkeit im Falle eines Ausfalls beträgt 100%. Forderungskategorien nach der alternativen Anwendung von hypothekarischer Besicherung ist nur erlaubt, wenn es keine eigene LGD-Schätzung gibt.

KREDITRISIKO BETEILIGUNGEN AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ

TEIL B

Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditrisikomindernde Techniken		Forderungswert		Forderungsgewichtete durchschnittliche Verlustquote bei Ausfall (LGD) in %	Risikogewichteter Forderungswert	Eigenmittelerfordernis	Zusatzinformationen:	
							Erwarteter Verlust	Wertberichtigungen und Rückstellungen
9	10	11	12	13	14	15	16	17
					8514000	7712050	8516000	8517000
8509005	8510005	8511005	8512005	8513005	8514005	8515005		
8509010	8510010	8511010	8512010	8513010	8514010	8515010		
8509015	8510015	8511015	8512015		8514015	8515015		
8509020	8510020	8511020	8512020		8514020	8515020		
8509025	8510025	8511025	8512025		8514025	8515025		
8509030	8510030	8511030	8512030		8514030	8515030		
					8514035	8515035	8517035	
					8514040	8515040	8517040	

KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ

TEIL A

VERBRIEFUNGSTYP:

< ... >

	Summe der verbrieften Forderungen (Originatorseitig)	Synthetische Verbriefungen: Besicherung der verbrieften Forderung			Verbriefungsposition	Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten							
		Sicherheiten mit Sicherungsleistungen (Cva) (-)	Summe Abflüsse (-)	Nominalbetrag der zurückbehaltenen/ zurückgegebenen Kreditbesicherung		Ursprüngliche Forderung vor Anwendung der Umrechnungsfaktoren	Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen - Angepasster Wert (Ga)	Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen	Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken				
			Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen - Angepasster Wert (Ga)						Summe Abflüsse (-)	Summe Zuflüsse (+)			
1	2	3	4	5	6	7	8	9					
Summe Forderungen	7200100	7200200	7200300	7200400	7200500	7200600	7200700	7200800	7200900				
Hievon: Wiederverbriefung	7200102	7200202	7200302	7200402	7200502	7200602	7200702	7200802	7200902				
Originator: Summe Forderungen	7200105	7200205	7200305	7200405	7200505	7200605	7200705	7200805	7200905				
Bilanzielle Forderungen	7200110	7200210	7200310	7200410	7200510								
Verbriefung	A	7200111	7200211	7200311	7200411					7200511			
	B	7200112	7200212	7200312	7200412					7200512			
	C	7200114	7200214	7200314	7200414					7200514			
Wiederverbriefung	D	7200118	7200218	7200318	7200418					7200518			
	E	7200119	7200219	7200319	7200419					7200519			
Außerbilanzielle Forderungen und Derivate	7200130	7200230	7200330	7200430	7200530								
Verbriefung	A	7200131	7200231	7200331	7200431					7200531			
	B	7200132	7200232	7200332	7200432					7200532			
	C	7200134	7200234	7200334	7200434					7200534			
Wiederverbriefung	D	7200138	7200238	7200338	7200438					7200538			
	E	7200139	7200239	7200339	7200439					7200539			
Klausel über vorzeitige Rückzahlung	7200133	7200233	7200333	7200433	7200533								
Investor: Summe Forderungen					7200535					7200635	7200735	7200835	7200935
Hievon: Investorpositionen gegenüber Originatoren und Sponsoren, welche nicht unter die Regelungen des Art. 122a der Richtlinie 2009/111/EG fallen					7100537								
Bilanzielle Forderungen					7200540								
Verbriefung	A					7200541							
	B					7200542							
	C					7200544							
Wiederverbriefung	D					7200548							
	E					7200549							
Außerbilanzielle Forderungen und Derivate					7200560								
Verbriefung	A					7200561							
	B					7200562							
	C					7200564							
Wiederverbriefung	D					7200568							
	E					7200569							
Sponsor: Summe Forderungen					7200565	7200665	7200765	7200865	7200965				
Bilanzielle Forderungen					7200570								
Außerbilanzielle Forderungen und Derivate					7200575								

KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ

TEIL B

Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditrisikomindernde Techniken	Kreditrisikomindernde Techniken in Form von Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen, ausgenommen andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen; Finanzielle Sicherheiten bei Anwendung der umfassenden Methode (CVAM) (-)	Vollständig angepasster Forderungswert (E*)	Aufgliederung des vollständig angepassten Forderungswertes (E*) bei außerbilanziellen Geschäften durch Umrechnungsfaktoren				Forderungswert	Abzug von den Eigenmitteln (-)	Zuordnung von Risikogewichten
			0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%			
10	11	12	13	14	15	16	17	18	19=17-18
7201000	7201100	7201200	7201300	7201400	7201500	7201600	7201700	7201800	7201900
7201002	7201102	7201202	7201302	7201402	7201502	7201602	7201702	7201802	7201902
7201005	7201105	7201205	7201305	7201405	7201505	7201605	7201705	7201805	7201905
7201230							7201710	7201810	7201910
							7201711	7201811	7201911
							7201712	7201812	7201912
							7201714	7201814	7201914
							7201718	7201818	7201918
							7201719	7201819	7201919
							7201730	7201830	7201930
							7201731	7201831	7201931
							7201732	7201832	7201932
							7201734	7201834	7201934
							7201738	7201838	7201938
							7201739	7201839	7201939
							7201733	7201833	7201933
							7201735	7201835	7201935
7201035	7201135	7201235	7201335	7201435	7201535	7201635	7201735	7201835	7201935
7201260							7201740	7201840	7201940
							7201741	7201841	7201941
							7201742	7201842	7201942
							7201744	7201844	7201944
							7201748	7201848	7201948
							7201749	7201849	7201949
							7201760	7201860	7201960
							7201761	7201861	7201961
							7201762	7201862	7201962
							7201764	7201864	7201964
							7201768	7201868	7201968
7201065	7201165	7201265	7201365	7201465	7201565	7201665	7201765	7201865	7201965
7201275							7201770	7201870	7201970
							7201775	7201875	7201975

KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ

TEIL C

Aufschlüsselung der Verbriefungspositionen gemäß Risikogewichten																	
Mit Rating (Bonitätsstufe 1 bis 11)																1250%	
7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	150%	200%	225%	250%	300%	350%	425%	500%	650%	750%	850%	Mit Rating	Ohne Rating
20	21	22	23	24	24b	24c	24d	25	25b	25c	26	26b	27	27b	27c	28	29
7202000	7202100	7202200	7202300	7202400	7204000	7204100	7204200	7202500	7204300	7204400	7202600	7204500	7202700	7204600	7204700	7202800	7202900
		7202202	7202302	7202402	7204002	7204102	7204202		7204302	7204402		7204502	7202702	7204602	7204702	7202802	7202902
7202005	7202105	7202205	7202305	7202405	7204005	7204105	7204205	7202505	7204305	7204405	7202605	7204505	7202705	7204605	7204705	7202805	7202905
7202010	7202110	7202210	7202310	7202410	7204010	7204110	7204210	7202510	7204310	7204410	7202610	7204510	7202710	7204610	7204710	7202810	7202910
7202011	7202111	7202211	7202311	7202411				7202511			7202611		7202711			7202811	7202911
	7202112	7202212	7202312	7202412				7202512			7202612		7202712			7202812	7202912
		7202214	7202314	7202414				7202514			7202614		7202714			7202814	7202914
		7202218	7202318	7202418	7204018	7204118			7204318			7204518		7204618		7202818	7202918
		7202219	7202319	7202419	7204019		7204219			7204419		7204519	7202719		7204719	7202819	7202919
7202030	7202130	7202230	7202330	7202430	7204030	7204130	7204230	7202530	7204330	7204430	7202630	7204530	7202730	7204630	7204730	7202830	7202930
7202031	7202131	7202231	7202331	7202431				7202531			7202631		7202731			7202831	7202931
	7202132	7202232	7202332	7202432				7202532			7202632		7202732			7202832	7202932
		7202234	7202334	7202434				7202534			7202634		7202734			7202834	7202934
		7202238	7202338	7202438	7204038	7204138			7204338			7204538		7204638		7202838	7202938
		7202239	7202339	7202439	7204039		7204239			7204439		7204539	7202739		7204739	7202839	7202939
7202033	7202133	7202233	7202333	7202433	7204033	7204133	7204233	7202533	7204333	7204433	7202633	7204533	7202733	7204633	7204733	7202833	7202933
7202035	7202135	7202235	7202335	7202435	7204035	7204135	7204235	7202535	7204335	7204435	7202635	7204535	7202735	7204635	7204735	7202835	7202935
7202040	7202140	7202240	7202340	7202440	7204040	7204140	7204240	7202540	7204340	7204440	7202640	7204540	7202740	7204640	7204740	7202840	7202940
7202041	7202141	7202241	7202341	7202441				7202541			7202641		7202741			7202841	7202941
	7202142	7202242	7202342	7202442				7202542			7202642		7202742			7202842	7202942
		7202244	7202344	7202444				7202544			7202644		7202744			7202844	7202944
		7202248	7202348	7202448	7204048	7204148			7204348			7204548		7204648		7202848	7202948
		7202249	7202349	7202449	7204049		7204249			7204449		7204549	7202749		7204749	7202849	7202949
7202060	7202160	7202260	7202360	7202460	7204060	7204160	7204260	7202560	7204360	7204460	7202660	7204560	7202760	7204660	7204760	7202860	7202960
7202061	7202161	7202261	7202361	7202461				7202561			7202661		7202761			7202861	7202961
	7202162	7202262	7202362	7202462				7202562			7202662		7202762			7202862	7202962
		7202264	7202364	7202464				7202564			7202664		7202764			7202864	7202964
		7202268	7202368	7202468	7204068	7204168			7204368			7204568		7204668		7202868	7202968
		7202269	7202369	7202469	7204069		7204269			7204469		7204569	7202769		7204769	7202869	7202969
7202065	7202165	7202265	7202365	7202465	7204065	7204165	7204265	7202565	7204365	7204465	7202665	7204565	7202765	7204665	7204765	7202865	7202965
7202070	7202170	7202270	7202370	7202470	7204070	7204170	7204270	7202570	7204370	7204470	7202670	7204570	7202770	7204670	7204770	7202870	7202970
7202075	7202175	7202275	7202375	7202475	7204075	7204175	7204275	7202575	7204375	7204475	7202675	7204575	7202775	7204675	7204775	7202875	7202975

KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ

TEIL D

Aufschlüsselung der Verbriefungspositionen gemäß Risikogewichten					Reduktion der risikogewichteten Forderungsposition aufgrund von Wertberichtigungen und Rückstellungen	Risikogewichtete Forderungsposition	Gesamteffekt (Anpassung) auf die risikogewichtete Forderungsposition auf Grund von Verstößen gegen die Sorgfaltspflicht	Gestamteffekt (Anpassung) auf die risikogewichtete Forderungsposition aufgrund von Laufzeitinkongruenzen	Eigenmittel -erfordernis vor "CAP"	Zusatzangabe: Kapitalefordernis entsprechend den Abflüssen von der SA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Eigenmittel -erfordernis nach "CAP"
Aufsichtlicher Formelansatz		Transparenzmethode	Interner Bemessungsansatz								
Durchschnittliches Risikogewicht	Durchschnittliches Risikogewicht										
30	31	32	33	34	35	36	36a	36b	37	38	39
7203000	7203100	7203200	7203300	7203400	7203500	7203600	7203900	7204800	7203700	7203800	7712055
7203002	7203102	7203202	7203302	7203402	7203502	7203602	7203902	7204802	7203702	7203802	7712057
7203005	7203105	7203205	7203305	7203405	7203505	7203605	7203905	7204805	7203705		
7203010	7203110	7203210	7203310	7203410	7203510	7203610			7203710		
7203011	7203111		7203311	7203411	7203511	7203611			7203711		
7203012	7203112		7203312	7203412	7203512	7203612			7203712		
7203014	7203114		7203314	7203414	7203514	7203614			7203714		
7203018	7203118		7203318	7203418	7203518	7203618			7203718		
7203019	7203119		7203319	7203419	7203519	7203619			7203719		
7203030	7203130	7203230	7203330	7203430	7203530	7203630			7203730		
7203031	7203131	7203231	7203331	7203431	7203531	7203631			7203731		
7203032	7203132	7203232	7203332	7203432	7203532	7203632			7203732		
7203034	7203134	7203234	7203334	7203434	7203534	7203634			7203734		
7203038	7203138	7203238	7203338	7203438	7203538	7203638			7203738		
7203039	7203139	7203239	7203339	7203439	7203539	7203639			7203739		
7203033	7203133	7203233	7203333	7203433	7203533	7203633			7203733		
7203035	7203135	7203235	7203335	7203435	7203535	7203635	7203935	7204835	7203735		
7203040	7203140	7203240	7203340	7203440	7203540	7203640	7203940	7204840	7203740		
7203041	7203141	7203241	7203341	7203441	7203541	7203641			7203741		
7203042	7203142	7203242	7203342	7203442	7203542	7203642			7203742		
7203044	7203144	7203244	7203344	7203444	7203544	7203644			7203744		
7203048	7203148	7203248	7203348	7203448	7203548	7203648			7203748		
7203049	7203149	7203249	7203349	7203449	7203549	7203649			7203749		
7203060	7203160	7203260	7203360	7203460	7203560	7203660	7203960	7204860	7203760		
7203061	7203161	7203261	7203361	7203461	7203561	7203661			7203761		
7203062	7203162	7203262	7203362	7203462	7203562	7203662			7203762		
7203064	7203164	7203264	7203364	7203464	7203564	7203664			7203764		
7203068	7203168	7203268	7203368	7203468	7203568	7203668			7203768		
7203069	7203169	7203269	7203369	7203469	7203569	7203669			7203769		
7203065	7203165	7203265	7203365	7203465	7203565	7203665	7203965	7204865	7203765		
7203070	7203170	7203270	7203370	7203470	7203570	7203670			7203770		
7203075	7203175	7203275	7203375	7203475	7203575	7203675			7203775		

KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN DETAILS: DETAILLIERTE INFORMATIONEN ZU VERBRIEFUNGEN DURCH ORIGINATOREN UND SPONSOREN
TEIL A

Laufende Nummer	Kennung der Verbriefung	Verbriefungstyp (Traditionell / Synthetisch)	Verbriefung oder Wiederverbriefung	Zurückbehaltener Anteil (Retention)			Rolle des Instituts: Sponsor/ Originator/ Ursprünglicher Kreditgeber	Nicht-ABCP (asset backed commercial paper) Programme		Verbriefte Forderungen (Originatorseitig)							
				Methode für die Berechnung des zurückbehaltenen Anteils	zurückbehaltener Anteil zum Meldestichtag in %	Compliance bezüglich des zurückbehaltenen Anteils		Verbriefungsdatum (mm/jjjj)	Summe der verbrieften Forderungen (originatorseitig zum Zeitpunkt des Verbriefungsdatums)	Summe	Institutsanteil (%)	Typ	Angewandeter Ansatz (SA/IRB/MIX)	Anzahl der Forderungen	ELGD (%)	Wertberichtigungen und Rückstellungen	Eigenmittelerfordernis vor Verbriefung in % der Forderungsbeträge
1	2	3	3a	3b	3c	3d	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14
<..>	7300002	7300003	7300032	7300030	7300031	7300033	7300004	7300005	7300006	7300007	7300008	7300009	7300010	7300011	7300012	7300013	7300014

KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN DETAILS: DETAILLIERTE INFORMATIONEN ZU VERBRIEFUNGEN DURCH ORIGINATOREN UND SPONSOREN
TEIL B

Verbriefungsstruktur	Verbriefungspositionen (Ursprüngliche Forderung vor Anwendung der Umrechnungsfaktoren)											Abzug von den Eigenmitteln (-)	Eigenmittelerfordernis vor "CAP"	Eigenmittelerfordernis nach "CAP"
	Bilanzielle Forderungen						Außerbilanzielle Forderungen und Derivate			Vorzeitige Rückzahlung (early amortisation)				
	<i>Most Senior</i>		<i>Mezzanine</i>		<i>First Loss</i>		Direktes Kreditsubstitut	Anerkannte Liquiditätsfazilitäten	Andere	Kontrolliert? (Ja/Nein)	Angewandeter Umrechnungsfaktor			
Mit Rating	Ohne Rating	Mit Rating	Ohne Rating	Mit Rating	Ohne Rating									
15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29
7300015	7300016	7300017	7300018	7300019	7300020	7300021	7300022	7300023	7300024	7300025	7300026	7300027	7300028	7300029

Kapitel "Operationelles Risiko"

Periodizität: Vierteljährlich

OPERATIONELLES RISIKO

Bankgeschäfte	Betriebserträge			Summe aushaftender Kredite und Darlehen (bei Anwendung des Alternativen Standardansatzes)			Eigenmittelerfordernis		Zusatzangaben zum Fortgeschrittenen Messansatz (AMA), sofern anwendbar					
	Jahr-3	Jahr-2	Vorjahr	Durchschnitt Jahr-3	Durchschnitt Jahr-2	Durchschnitt Vorjahr	Eigenmittelerfordernis	Hievon: durch Allokationsmechanismus zugeteilt	Eigenmittelerfordernis vor Anrechnung von erwarteten Verlusten oder Risiko verlagernder Techniken	Aus Eigenmittelerfordernis herausgerechneter erwarteter Verlust	Eigenmittelerleichterung durch Risiko verlagernde Techniken	Hievon: durch Versicherungen	Überschussbetrag anrechenbarer risiko-verlagernder Techniken	
	1	2	3	4	5	6								7
Basis-indikatoransatz	9001000	9002000	9003000				7741000							
Standardansatz (SA)/ Alternativer Standardansatz (ASA)							7742000							
Standardansatz														
Unternehmensfinanzierung	9001005	9002005	9003005											
Handel	9001010	9002010	9003010											
Wertpapiergeschäft	9001015	9002015	9003015											
Firmenkundengeschäft	9001020	9002020	9003020											
Privatkundengeschäft	9001025	9002025	9003025											
Zahlungsverkehr und Abwicklung	9001030	9002030	9003030											
Depot- und Treuhandgeschäft	9001035	9002035	9003035											
Vermögensverwaltung	9001040	9002040	9003040											
Alternativer Standardansatz (ASA)														
Firmenkundengeschäft	9001045	9002045	9003045	9004045	9005045	9006045								
Privatkundengeschäft	9001050	9002050	9003050	9004050	9005050	9006050								
Fortgeschrittener Messansatz (AMA)	9001055	9002055	9003055				7743000	9008055	9009055	9010055	9011055	9012055	9013055	

Kapitel "Positionen des Handelsbuchs"

Periodizität: Vierteljährlich

MARKTRISIKO ZINSBEZOGENER INSTRUMENTE IM HANDELSBUCH (§ 207f SolvaV)

	ungewichtet	Risikogewicht in %	Eigenmittelerfordernis
	1	2	3
Zinsbezogene Instrumente des Handelsbuchs			7731016 (Summe 1+2+3+4+5)
1. Allgemeines Positionsrisiko. Laufzeitbandmethode			5003005
2. Allgemeines Positionsrisiko. Durationsmethode			5003010
3. Spezifisches Positionsrisiko gemäß § 207 SolvaV	5001015		5003015 (Summe 3.1+3.2+3.3+3.4+3.5)
3.1 zinsbezogene Instrumente der ersten Kategorie	5001020	0,00	5003020
3.2 zinsbezogene Instrumente der zweiten Kategorie	5001025 (Summe)		5003025 (Summe)
3.2.a bis 6 Monate	5001030	0,25	5003030
3.2.b über 6 Monate	5001035	1,00	5003035
3.2.c über 24 Monate	5001040	1,60	5003040
3.3 zinsbezogene Instrumente der dritten Kategorie	5001045	8,00	5003045
3.4 zinsbezogene Instrumente der vierten Kategorie	5001050	12,00	5003050
3.5 verbriefte Forderungen, die mit max. 1250% und darunter zu gewichten sind sowie Positionen ohne Rating einer anerkannten Ratingagentur	5001051		5003051
4. Positionsrisiko Investmentfonds gemäß § 211 Abs. 2 SolvaV			5003055
5. Nicht-lineare Optionsrisiken			5003060

MARKTRISIKO POSITIONSRISIKO IN SUBSTANZWERTEN GEMÄß § 209 SolvaV

	ungewichtet	Risikogewicht in %	EM-Erfordernis
	1	2	3
Substanzwerte im Handelsbuch			7731020 (1+2+3+4+5)
1. Allgemeines Risiko	5101005	8,00	5103005
2. Spezifisches Risiko	5101010	8,00	5103010
3. Aktienindexterminkontrakte bei Anwendung von § 210 Abs. 2 SolvaV	5101025		5103025
4. Nicht-lineare Optionsrisiken			5103030
5 Positionsrisiko Investmentfonds gemäß § 211 Abs. 2 SolvaV			5103035

MARKTRISIKO ABWICKLUNGSRISIKO GEMÄß § 214 SolvaV

Abwicklungsrisiko	ungewichtet	Risikogewicht in %	Eigenmittelerfordernis
	1	2	3
1. Anzahl der Arbeitstage nach dem festgesetzten Abrechnungstermin (Bankbuch)			7720001
1.1. bis 4 Tage		0,0	
1.2. 5 bis 15 Tage	5301035	8,0	5303035
1.3. 16 bis 30 Tage	5301040	50,0	5303040
1.4. 31 bis 45 Tage	5301045	75,0	5303045
1.5. 46 und mehr Tage	5301050	100,0	5303050
2. Anzahl der Arbeitstage nach dem festgesetzten Abrechnungstermin (nur Handelsbuch)			7720002
2.1. bis 4 Tage		0,0	
2.2. 5 bis 15 Tage	5301015	8,0	5303015
2.3. 16 bis 30 Tage	5301020	50,0	5303020
2.4. 31 bis 45 Tage	5301025	75,0	5303025
2.5. 46 und mehr Tage	5301030	100,0	5303030

MARKTRISIKO: SPEZIFISCHES RISIKO IN VERBRIEFUNGEN – STANDARDANSATZ

Teil A

	Summe Positionen		(-) ABZUG VON DEN EIGENMITTELN		NETTO-POSITIONEN		AUFGLIEDERUNG DER NETTO-POSITIONEN (LONG) NACH SA- UND IRB-RISIKOGEWICHTEN																											
	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT	RISIKOGEWICHT < 1250%																	1250%		AUF SICHTLICHER FORMELANSATZ	TRANSPARENZ METHODE	INTERNER BEWERTUNGSANSATZ						
							7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	150%	200%	225%	250%	300%	350%	425%	500%	650%	750%	850%	MIT RATING	OHNE RATING	DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)			DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)	7 - 10%					
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29	30				
Summe Forderungen	5600100	5600200	5600300	5600400	5600500	5600600	5600700	5600800	5600900	5601000	5601100	5601200	5601300	5601400	5601500	5601600	5601700	5601800	5601900	5602000	5602100	5602200	5602300	5602400	5602500	5602600	5602700	5602800	5602900	5603000				
Hievon: WIEDERVERBRIEFUNG	5600102	5600202	5600302	5600402	5600502	5600602	5600702	5600802	5600902	5601002	5601102	5601202	5601302	5601402	5601502	5601602	5601702	5601802	5601902	5602002	5602102	5602202	5602302	5602402	5602502	5602602	5602702	5602802	5602902	5603002				
ORIGINATOR: Summe Forderungen	5600105	5600205	5600305	5600405	5600505	5600605	5600705	5600805	5600905	5601005	5601105	5601205	5601305	5601405	5601505	5601605	5601705	5601805	5601905	5602005	5602105	5602205	5602305	5602405	5602505	5602605	5602705	5602805	5602905	5603005				
VERBRIEFUNG	5600106	5600206	5600306	5600406	5600506	5600606	5600706	5600806	5600906	5601006	5601106				5601506		5601706	5601806		5602006			5602306	5602406	5602506	5602606	5602706	5602806	5602906	5603006				
WIEDERVERBRIEFUNG	5600107	5600207	5600307	5600407	5600507	5600607			5600907	5601007	5601107	5601207	5601307	5601407		5601607	5601707		5601907	5602007	5602107	5602207	5602307	5602407	5602507	5602607	5602707	5602807	5602907					
INVESTOR: Summe Forderungen	5600135	5600235	5600335	5600435	5600535	5600635	5600735	5600835	5600935	5601035	5601135	5601235	5601335	5601435	5601535	5601635	5601735	5601835	5601935	5602035	5602135	5602235	5602335	5602435	5602535	5602635	5602735	5602835	5602935	5603035				
Hievon: Investorpositionen gegenüber Originatoren und Sponsoren, welche nicht unter die Regelungen des Art. 122a der Richtlinie 2009/111/EG fallen	5600138	5600238	5600338	5600438	5600538	5600638																												
VERBRIEFUNG	5600136	5600236	5600336	5600436	5600536	5600636	5600736	5600836	5600936	5601036	5601136				5601536		5601736	5601836		5602036			5602336	5602436	5602536	5602636	5602736	5602836	5602936	5603036				
WIEDERVERBRIEFUNG	5600137	5600237	5600337	5600437	5600537	5600637			5600937	5601037	5601137	5601237	5601337	5601437		5601637	5601737		5601937	5602037	5602137	5602237	5602337	5602437	5602537	5602637	5602737	5602837	5602937					
SPONSOR: Summe Forderungen	5600165	5600265	5600365	5600465	5600565	5600665	5600765	5600865	5600965	5601065	5601165	5601265	5601365	5601465	5601565	5601665	5601765	5601865	5601965	5602065	5602165	5602265	5602365	5602465	5602565	5602665	5602765	5602865	5602965	5603065				
VERBRIEFUNG	5600166	5600266	5600366	5600466	5600566	5600666	5600766	5600866	5600966	5601066	5601166				5601566		5601766	5601866		5602066			5602366	5602466	5602566	5602666	5602766	5602866	5602966	5603066				
WIEDERVERBRIEFUNG	5600167	5600267	5600367	5600467	5600567	5600667			5600967	5601067	5601167	5601267	5601367	5601467		5601667	5601767		5601967	5602067	5602167	5602267	5602367	5602467	5602567	5602667	5602767	5602867	5602967					
AUFGLIEDERUNG DER GESAMTSUMME DER GEWICHTETEN NETTOPOSITIONEN (LONG UND SHORT) NACH UNDERLYINGS																																		
1. Kredite - besichert durch Wohnimmobilien																																		
2. Kredite - besichert durch gewerbliche Immobilien																																		
3. Kreditkartenforderungen																																		
4. Leasing																																		
5. Kredite an Unternehmen und KMUs																																		
6. Retailkredite																																		
7. Forderungen aus Lieferungen und Leistungen																																		
8. Verbriefungen																																		
9. Sonstige																																		

MARKTRISIKO: SPEZIFISCHES RISIKO IN VERBRIEFUNGEN - STANDARDANSATZ

Teil B

AUFGLIEDERUNG DER NETTO-POSITIONEN (SHORT) NACH SA- UND IRB-RISIKOGEWICHTEN																				GESAMTEFFEKT (ANPASSUNG) AUF DIE RISIKOGEWICHTETE FORDERUNGSPOSITION AUF GRUND VON VERSTÖSSEN GEGEN DIE SORGFALTPFLICHT		Risikogewichtete Forderungsposition vor Cap			Risikogewichtete Forderungsposition nach Cap			Eigenmittelerfordernis		
RISIKOGEWICHT < 1250%															1250%		AUF SICHTLICHER FORMELANSATZ	TRANSPARENZ METHODE	INTERNER BEMESSUNGSANSATZ		GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN LONG	GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN SHORT	SUMME DER GEWICHTETEN NETTO-POSITIONEN LONG UND SHORT	GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN LONG	GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN SHORT	SUMME DER GEWICHTETEN NETTO-POSITIONEN LONG UND SHORT				
12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	150%	200%	225%	250%	300%	350%	425%	500%	650%	750%	850%	MIT RATING	OHNE RATING			DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)	DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)							GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN LONG		GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN SHORT	GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN LONG
31	32	33	34	35	36	37	38	39	40	41	42	43	44	45	46	47	48	49	50	51	52	53	54	55	56	57	58	59	60	61
5603100	5603200	5603300	5603400	5603500	5603600	5603700	5603800	5603900	5604000	5604100	5604200	5604300	5604400	5604500	5604600	5604700	5604800	5604900	5605000	5605100	5605200	5605300	5605400	5605500	5605600	5605700	5605800	5605900	5606000	7731017
5603102	5603202	5603302	5603402	5603502	5603602	5603702	5603802	5603902	5604002	5604102	5604202	5604302	5604402	5604502	5604602	5604702	5604802	5604902	5605002	5605102	5605202	5605302	5605402	5605502	5605602	5605702	5605802	5605902	5606002	
5603105	5603205	5603305	5603405	5603505	5603605	5603705	5603805	5603905	5604005	5604105	5604205	5604305	5604405	5604505	5604605	5604705	5604805	5604905	5605005	5605105	5605205	5605305	5605405	5605505	5605605	5605705	5605805	5605905	5606005	
5603106	5603206	5603306	5603406				5603806		5604006	5604106		5604306			5604606	5604706	5604806	5604906	5605006	5605106	5605206	5605306	5605406	5605506	5605606	5605706	5605806	5605906	5606006	
	5603207	5603307	5603407	5603507	5603607	5603707		5603907	5604007		5604207	5604307	5604407	5604507	5604607	5604707	5604807	5604907	5605007	5605107	5605207			5605507	5605607	5605707	5605807	5605907	5606007	
5603135	5603235	5603335	5603435	5603535	5603635	5603735	5603835	5603935	5604035	5604135	5604235	5604335	5604435	5604535	5604635	5604735	5604835	5604935	5605035	5605135	5605235	5605335	5605435	5605535	5605635	5605735	5605835	5605935	5606035	
5603136	5603236	5603336	5603436				5603836		5604036	5604136		5604336			5604636	5604736	5604836	5604936	5605036	5605136	5605236	5605336	5605436	5605536	5605636	5605736	5605836	5605936	5606036	
	5603237	5603337	5603437	5603537	5603637	5603737		5603937	5604037		5604237	5604337	5604437	5604537	5604637	5604737	5604837	5604937	5605037	5605137	5605237			5605537	5605637	5605737	5605837	5605937	5606037	
5603165	5603265	5603365	5603465	5603565	5603665	5603765	5603865	5603965	5604065	5604165	5604265	5604365	5604465	5604565	5604665	5604765	5604865	5604965	5605065	5605165	5605265			5605565	5605665	5605765	5605865	5605965	5606065	
5603166	5603266	5603366	5603466				5603866		5604066	5604166		5604366			5604666	5604766	5604866	5604966	5605066	5605166	5605266			5605566	5605666	5605766	5605866	5605966	5606066	
	5603267	5603367	5603467	5603567	5603667	5603767		5603967	5604067		5604267	5604367	5604467	5604567	5604667	5604767	5604867	5604967	5605067	5605167	5605267			5605567	5605667	5605767	5605867	5605967	5606067	
																									5605771				5606071	
																									5605772				5606072	
																									5605773				5606073	
																									5605774				5606074	
																									5605775				5606075	
																									5605776				5606076	
																									5605777				5606077	
																									5605778				5606078	
																									5605779				5606079	

MARKTRISIKO: SPEZIFISCHES RISIKO IM CORRELATION TRADING PORTFOLIO - STANDARDANSATZ

Teil A

	Summe Positionen		(-) ABGEZOGENE POSITIONEN VOM EIGENKAPITAL		NETTO-POSITIONEN		AUFGLIEDERUNG DER NETTO-POSITIONEN (LONG) NACH SA- UND IRB-RISIKOGEWICHTEN																
	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT	RISIKOGEWICHT < 1250%									1250%		AUF SICHTLICHER FORMELANSATZ	TRANSPARENZ METHODE	INTERNER BEMESSUNGSANSATZ		Sonstige	
							7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	250%	350%	425%	650%	MIT RATING	OHNE RATING			DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)	DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)		
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23
Summe Forderungen	5700100	5700200	5700300	5700400	5700500	5700600	5700700	5700800	5700900	5701000	5701100	5701200	5701300	5701400	5701500	5701600	5701700	5701800	5701900	5702000	5702100	5702200	5702300
ORIGINATOR: Summe Forderungen	5700105	5700205	5700305	5700405	5700505	5700605	5700705	5700805	5700905	5701005	5701105	5701205	5701305	5701405	5701505	5701605	5701705	5701805	5701905	5702005	5702105	5702205	5702305
VERBRIEFUNGEN	5700110	5700210	5700310	5700410	5700510	5700610	5700710	5700810	5700910	5701010	5701110	5701210	5701310	5701410	5701510	5701610	5701710	5701810	5701910	5702010	5702110	5702210	
N-TH-TO-DEFAULT CREDIT DERIVATIVES	5700115	5700215	5700315	5700415	5700515	5700615	5700715	5700815	5700915	5701015	5701115	5701215	5701315	5701415	5701515	5701615	5701715	5701815	5701915	5702015	5702115	5702215	5702315
ANDERE CTP-POSITIONEN	5700120	5700220	5700320	5700420	5700520	5700620	5700720	5700820	5700920	5701020	5701120	5701220	5701320	5701420	5701520	5701620	5701720	5701820	5701920	5702020	5702120	5702220	5702320
INVESTOR: Summe Forderungen	5700135	5700235	5700335	5700435	5700535	5700635	5700735	5700835	5700935	5701035	5701135	5701235	5701335	5701435	5701535	5701635	5701735	5701835	5701935	5702035	5702135	5702235	5702335
VERBRIEFUNGEN	5700140	5700240	5700340	5700440	5700540	5700640	5700740	5700840	5700940	5701040	5701140	5701240	5701340	5701440	5701540	5701640	5701740	5701840	5701940	5702040	5702140	5702240	
N-TH-TO-DEFAULT CREDIT DERIVATIVES	5700145	5700245	5700345	5700445	5700545	5700645	5700745	5700845	5700945	5701045	5701145	5701245	5701345	5701445	5701545	5701645	5701745	5701845	5701945	5702045	5702145	5702245	5702345
ANDERE CTP-POSITIONEN	5700150	5700250	5700350	5700450	5700550	5700650	5700750	5700850	5700950	5701050	5701150	5701250	5701350	5701450	5701550	5701650	5701750	5701850	5701950	5702050	5702150	5702250	5702350
SPONSOR: GESAMTVERPFLICHTUNGEN	5700165	5700265	5700365	5700465	5700565	5700665	5700765	5700865	5700965	5701065	5701165	5701265	5701365	5701465	5701565	5701665	5701765	5701865	5701965	5702065	5702165	5702265	5702365
VERBRIEFUNGEN	5700170	5700270	5700370	5700470	5700570	5700670	5700770	5700870	5700970	5701070	5701170	5701270	5701370	5701470	5701570	5701670	5701770	5701870	5701970	5702070	5702170	5702270	
N-TH-TO-DEFAULT CREDIT DERIVATIVES	5700175	5700275	5700375	5700475	5700575	5700675	5700775	5700875	5700975	5701075	5701175	5701275	5701375	5701475	5701575	5701675	5701775	5701875	5701975	5702075	5702175	5702275	5702375
ANDERE CTP-POSITIONEN	5700180	5700280	5700380	5700480	5700580	5700680	5700780	5700880	5700980	5701080	5701180	5701280	5701380	5701480	5701580	5701680	5701780	5701880	5701980	5702080	5702180	5702280	5702380

MARKTRISIKO: SPEZIFISCHES RISIKO IM CORRELATING TRADING PORTFOLIO - STANDARDANSATZ

Teil B

AUFGLIEDERUNG DER NETTO-POSITIONEN (SHORT) NACH SA- UND IRB-RISIKOGEWICHTEN																				Risikogewichtete Forderungsposition vor Cap		Risikogewichtete Forderungsposition nach Cap		Eigenmittel-erfordernis
RISIKOGEWICHT < 1250%									1250%		AUF SICHTLICHER FORMELANSATZ		TRANSPARENZ-METHODE	INTERNER BEMESSUNGSANSATZ			GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN LONG	GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN SHORT	GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN LONG	GEWICHTETE NETTO-POSITIONEN SHORT				
7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	250%	350%	425%	650%	MIT RATING	OHNE RATING	DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)	DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)		Sonstige										
24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	34	35	36	37	38	39	40	41	42	43	44	45			
5702400	5702500	5702600	5702700	5702800	5702900	5703000	5703100	5703200	5703300	5703400	5703500	5703600	5703700	5703800	5703900	5704000	5704100	5704200	5704300	5704400	7731018			
5702405	5702505	5702605	5702705	5702805	5702905	5703005	5703105	5703205	5703305	5703405	5703505	5703605	5703705	5703805	5703905	5704005	5704105	5704205	5704305	5704405				
5702410	5702510	5702610	5702710	5702810	5702910	5703010	5703110	5703210	5703310	5703410	5703510	5703610	5703710	5703810	5703910		5704110	5704210	5704310	5704410				
5702415	5702515	5702615	5702715	5702815	5702915	5703015	5703115	5703215	5703315	5703415	5703515	5703615	5703715	5703815	5703915	5704015	5704115	5704215	5704315	5704415				
5702420	5702520	5702620	5702720	5702820	5702920	5703020	5703120	5703220	5703320	5703420	5703520	5703620	5703720	5703820	5703920	5704020	5704120	5704220	5704320	5704420				
5702435	5702535	5702635	5702735	5702835	5702935	5703035	5703135	5703235	5703335	5703435	5703535	5703635	5703735	5703835	5703935	5704035	5704135	5704235	5704335	5704435				
5702440	5702540	5702640	5702740	5702840	5702940	5703040	5703140	5703240	5703340	5703440	5703540	5703640	5703740	5703840	5703940		5704140	5704240	5704340	5704440				
5702445	5702545	5702645	5702745	5702845	5702945	5703045	5703145	5703245	5703345	5703445	5703545	5703645	5703745	5703845	5703945	5704045	5704145	5704245	5704345	5704445				
5702450	5702550	5702650	5702750	5702850	5702950	5703050	5703150	5703250	5703350	5703450	5703550	5703650	5703750	5703850	5703950	5704050	5704150	5704250	5704350	5704450				
5702465	5702565	5702665	5702765	5702865	5702965	5703065	5703165	5703265	5703365	5703465	5703565	5703665	5703765	5703865	5703965	5704065	5704165	5704265	5704365	5704465				
5702470	5702570	5702670	5702770	5702870	5702970	5703070	5703170	5703270	5703370	5703470	5703570	5703670	5703770	5703870	5703970		5704170	5704270	5704370	5704470				
5702475	5702575	5702675	5702775	5702875	5702975	5703075	5703175	5703275	5703375	5703475	5703575	5703675	5703775	5703875	5703975	5704075	5704175	5704275	5704375	5704475				
5702480	5702580	5702680	5702780	5702880	5702980	5703080	5703180	5703280	5703380	5703480	5703580	5703680	5703780	5703880	5703980	5704080	5704180	5704280	5704380	5704480				

MARKTRISIKO STANDARDANSATZ FÜR FREMDWÄHRUNGSRIKIO

	Summe Positionen				NETTO-POSITIONEN		UNGEWICHTET (einschließlich der Wiederverteilung von nicht ausgeglichenen Positionen in Währungen, die besonderen Bestimmungen von ausgeglichenen Positionen unterliegen)			RISIKOGEWICHT (%)			EIGENMITTEL-ERFORDERNIS
	LONG	SHORT	Zusatzinformationen: Hedging-Positionen der Capital Ratio				LONG	SHORT	LONG	SHORT	MATCHED	LONG	
			Long	Short	(7)	(8)							
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)				
GESAMTPOSITION	5800100	5800200	5800300	5800400	5800500	5800600	5800700	5800800	5800900				7731025
1 Währungen der zweiten Stufe der WWU	5800101	5800201	5800301	5800401	5800501	5800601			5800901			1,6	5801001
2 Währungen aufgrund zwischenstaatlicher Vereinbarungen	5800102	5800202	5800302	5800402	5800502	5800602			5800902				5801002
3 Eng verbundene Währungen	5800103	5800203	5800303	5800403	5800503	5800603			5800903			4,00	5801003
4 Alle anderen Währungen (inklusive Collective Investment Undertakings - CIUs)	5800104	5800204	5800304	5800404	5800504	5800604	5800704	5800804		8,00	8,00		5801004
5 Gold	5800105	5800205	5800305	5800405	5800505	5800605	5800705	5800805		8,00	8,00		5801005
6 Sonstige Nicht-Delta Risiken für Währungsoptionen													5801006
Zusatzinformationen: Währungspositionen													
Euro	5800110	5800210	5800310	5800410	5800510	5800610							
Ausgewählte CEE-Währungen	5800115	5800215	5800315	5800415	5800515	5800615							
BAM	5800116	5800216	5800316	5800416	5800516	5800616							
BGN	5800117	5800217	5800317	5800417	5800517	5800617							
CZK	5800118	5800218	5800318	5800418	5800518	5800618							
HRK	5800120	5800220	5800320	5800420	5800520	5800620							
HUF	5800121	5800221	5800321	5800421	5800521	5800621							
KZT	5800122	5800222	5800322	5800422	5800522	5800622							
LTL	5800123	5800223	5800323	5800423	5800523	5800623							
LVL	5800124	5800224	5800324	5800424	5800524	5800624							
PLN	5800125	5800225	5800325	5800425	5800525	5800625							
RON	5800126	5800226	5800326	5800426	5800526	5800626							
RSD	5800127	5800227	5800327	5800427	5800527	5800627							
RUB	5800128	5800228	5800328	5800428	5800528	5800628							
UAH	5800129	5800229	5800329	5800429	5800529	5800629							
GBP	5800140	5800240	5800340	5800440	5800540	5800640							
DKK	5800143	5800243	5800343	5800443	5800543	5800643							
SEK	5800145	5800245	5800345	5800445	5800545	5800645							
sonstige EWR-Währungen	5800150	5800250	5800350	5800450	5800550	5800650							
CHF	5800155	5800255	5800355	5800455	5800555	5800655							
USD	5800160	5800260	5800360	5800460	5800560	5800660							
CAD	5800165	5800265	5800365	5800465	5800565	5800665							
AUD	5800170	5800270	5800370	5800470	5800570	5800670							
JPY	5800175	5800275	5800375	5800475	5800575	5800675							
sonstige NICHT-EWR-Währungen	5800180	5800280	5800380	5800480	5800580	5800680							
Collective Investment Undertakings als eigene Währung	5800185	5800285	5800385	5800485	5800585	5800685							

MARKTRISIKO: INTERNE MODELLE

Teil A

	VaR		STRESSED VaR		Ausfalls- und Migrationsrisikozuschlag (Incremental Risk Charge)	
	Durchschnitt der letzten 60 Tage (VaRavg) x Multiplikator (m_c)	VaR des Vortages (VaR _{t-1})	Durchschnitt der letzten 60 Tage (SVaRavg) x Multiplikator (m_s)	Letzter verfügbarer SVaR (SVaR _{t-1})	12-Wochen Durchschnittswert	Letzter Wert
	-1	-2	(3a)	(3b)	(4a)	(4b)
Gesamtpositionen	5201000	5202000	5208000	5209000	5210000	5211000
Marktrisikokomponenten						
1. Zinsbezogene Instrumente	5201005	5202005	5208005	5209005		
1.1 Zinsbez. Instrumente - Allgemeines Positionsrisiko	5201010	5202010	5208010	5209010		
1.2 Zinsbez. Instrumente - Spezifisches Positionsrisiko	5201015	5202015	5208015	5209015		
2. Substanzwerte	5201020	5202020	5208020	5209020		
2.1 Substanzwerte - Allgemeines Positionsrisiko	5201025	5202025	5208025	5209025		
2.2 Substanzwerte - Spezifisches Positionsrisiko	5201030	5202030	5208030	5209030		
3. Fremdwährungsrisiko	5201035	5202035	5208035	5209035		
4. Warenpositionsrisiko	5201040	5202040	5208040	5209040		
5. Allgemeines Positionsrisiko - Gesamt	5201045	5202045	5208045	5209045		
6. Spezifisches Positionsrisiko - Gesamt	5201050	5202050	5208050	5209050		

MARKTRISIKO: INTERNE MODELLE

Teil B

Gesamtpreisrisiken für Correlation Trading Portfolio (CTP)				Eigenmittelerfordernis	Zusatzinformationen				
Floor	12-Wochen Durchschnittswert	Letzter Wert	Zuschlag für zusätzliche Risiken (Stresstest)		Anzahl der Überschreitungen innerhalb der letzten 250 Arbeitstage	VaR Multiplikator (m_c)	SVaR Multiplikator (m_s)	Angenommener Zuschlag für CTP FLOOR - Gewichtete Netto Long Positionen nach CAP	Angenommener Zuschlag für CTP FLOOR - Gewichtete Netto Short Positionen nach CAP
(4c) = 8% * max[(8), (9)]	(4d)	(4e)	(4f)	(5) = Max[(1),(2)] + Max[(3a),(3b)] + Max [(4a),(4b)] + Max [(4c), (4d),(4e)] + (4f)	-6	(7a)	(7b)	-8	-9
5212000	5213000	5214000	5215000	7732000	5216000	5217000	5218000	5219000	5220000

Kapitel "Fortsetzung Ordnungsnormen"

Periodizität: Monatlich

HANDELSBUCH - §§ 22n bis 22q BWG

1. Volumen des Handelsbuches gemäß § 22q Abs. 1 Z 1 bis 4 BWG	
	Anzahl der Tage
bis einschließlich 5 vH des Geschäftsvolumens	7751011
über 5 vH bis einschließlich 6 vH des Geschäftsvolumens	7751012
über 6 vH des Geschäftsvolumens	7751013
	Anzahl der Tage
bis einschließlich 15 Mio. EUR	7751021
über 15 Mio. EUR bis einschließlich 20 Mio. EUR	7751022
über 20 Mio. EUR	7751023
	Betrag
Geschäftsvolumen	7751001
Handelsbuch	7751002

**§ 25 BWG – LIQUIDITÄT
auf Basis von Restlaufzeiten**

1. Liquidität 1	
a) Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 7 Z 1 BWG (nur von Zentralinstituten auszufüllen)	Durchschnitt¹
Einlagen bei Zentralinstituten unter 30 Tagen (gemäß § 25 Abs. 4 Z 1 BWG)	6311100
b) Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 7 Z 2 BWG	Durchschnitt²
Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 4 Z 1 bis 5 BWG	6400100
- Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 5 Z 1 bis 6 BWG	6401100
Summe der Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 4 und 5 BWG	6402100
c) Flüssige Mittel 1. Grades gemäß § 25 Abs. 6 BWG	Durchschnitt³
Summe	6500100
2. Liquidität 2	
a) Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 8 BWG	15. des Berichtsmonats
Euro-Verpflichtungen Liquidität 1 gemäß § 25 Abs. 8 Z 1 BWG	6403115
+ Euro-Verpflichtungen Liquidität 2 gemäß § 25 Abs. 8 Z 2 bis 5 BWG	6600115
- Euro-Verpflichtungen Liquidität 2 gemäß § 25 Abs. 9 BWG	6601115
Summe	6602115
b) Flüssige Mittel 2. Grades gemäß § 25 Abs. 10 und 11 BWG	Ultimo des Berichtsmonats
Flüssige Mittel 2. Grades gemäß § 25 Abs. 10 Z 1 bis 9 BWG	6700131
. Überschuss Liquidität 1 gemäß § 25 Abs. 10 Z 7 BWG	6723131
- Flüssige Mittel 2. Grades gemäß § 25 Abs. 11 BWG	6701131
Summe	6702131

¹ Arithmetisches Mittel der Tagesendstände am Letzten des vorletzten Monats sowie am 7., 15. und 23. des Vormonats.

² Arithmetisches Mittel der Tagesstände am Letzten des Vormonats sowie am 7., 15. und 23. des laufenden Monats.

³ Kalenderdurchschnitt

1. A) Großveranlagung gemäß § 27 Abs. 2 Z 1 und 2 BWG

B) Großveranlagung gemäß § 27 Abs. 2 BWG nach Gewichtung

C) Inanspruchnahme der Übergangsbestimmung der vertraglichen Bindung gemäß § 103 Z 21 lit. d BWG

Meldeblock A										Meldeblock B			Meldeblock C	
Ident-nummer	GVA-Kenn-zeichen ¹	Veranlagung vor Risiko-vorsorge	GVA nach Abzug von Risiko-vorsorge	Hievon: Kategorien gemäß § 27 Abs. 2 BWG		Zurechnung zu Dritten gemäß § 27 Abs. 13 BWG		Sicherheiten mit Sicherheits-leistungen		GVA nach Zurechnungen und Sicherheiten	Gewicht	Un-gewichteter Wert	Gewichteter Wert	Vertraglich gebundener Wert nach Gewichtung
						Ident-nummer	Betrag	Ident-nummer ²	Betrag					
<...>	7410001	7410002	7410004	Aktivposten	7410005	<...>	7410009	<...>	7410010	7410011	mit 0%-Gewichtung	7410012		
										mit 20%-Gewichtung	7410015	7410016	7410017	
				Außerbilanzmäßige Geschäfte	7410006					mit 50%-Gewichtung	7410018	7410019	7410020	
				Derivate	7410007					mit 100%-Gewichtung	7410021	7410022	7410023	
				Positionen des Handelsbuchs	7410008					mit anderen Gewichten	7410024	7410025	7410026	
										Summe	7410027	7410028	7410029	

1) Kennzeichen: non-credit institutions: "1", credit institutions: "2" (nur im Falle einer Einzel-ID anzugeben)

2) Im Falle einer hypothekarischen Besicherung ist die Dummy-ID "4905482" zu verwenden.

2. Zusatzangaben für unter Punkt 1 gemeldete Gruppen verbundener Kunden

Identnummer	Einzelidentnummern der Gruppe	GVA-Kennzeichen ³	GVA nach Abzug von Risikovorsorge	Veranlagung nach Ausnahmen und Vertragspartnergewichtung
<...>	<...>	7410041	7410003	7410043

3) Kennzeichen: non-credit institutions: "1", credit institutions: "2"

3. Großveranlagungen gemäß § 27 Abs. 2 BWG zum Ende des Geschäftsjahres

Identnummer	Höhe der voraussichtlichen Risikovorsorge
<...>	7410032

§ 29 BWG - BETEILIGUNGEN

Alle qualifizierten Beteiligungen über 15 vH der anrechenbaren Eigenmittel

Identnummer	Beteiligung Betrag
<...>	7900001

	Betrag
Gesamtbuchwert der qualifizierten Beteiligungen (an anderen Unternehmen als den in § 29 Abs. 1 Z 1 bis 3 BWG genannten)	7900000
Summe der Überschreitung der Beteiligungsgrenzen gemäß § 29 Abs. 1 BWG	7900011
Summe der Überschreitung der Beteiligungsgrenzen gemäß § 29 Abs. 2 BWG	7900012