

**Anhang  
zur Zweiten Verordnung  
zur weiteren Umsetzung  
der geänderten Bankenrichtlinie und  
der geänderten Kapitaladäquanzrichtlinie  
vom 26. Oktober 2011**

Anlage 3  
zur Solvabilitätsverordnung



# Meldeformulare

E UEB

## 1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko

Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>
Name:	<input type="text"/>	Ort:	<input type="text"/>
Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>
		Telefon:	<input type="text"/>

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
				02
0010	1	Anrechenbare Eigenmittel insgesamt		=1.1+1.2+1.3+1.6+1.7 =1.4+1.5+1.6
0020	1.1	Kernkapital		anrechenbares Kernkapital 1.1.1+1.1.2+1.1.3+1.1.4+1.1.5
0030	1.1.1	Eingezahltes Kapital		1.1.1.1+1.1.1.2+1.1.1.3+1.1.1.4
0051	1.1.1***	darunter (nachrichtlich): Kernkapitalinstrumente, die Aktien gleichgestellt sind		
0052	1.1.1****	darunter (nachrichtlich): Kernkapitalinstrumente, welche nicht- kumulative Vorzugsrechte auf Dividendenzahlungen beinhalten		
0060	1.1.1.1	Eingezahltes Kapital (Geschäfts-, Grund-, Stamm-, Dotationskapital und Geschäftsguthaben) ohne kumulative Vorzugsaktien		Hier zu erfassen sind: Eingezahltes Kapital (Geschäfts-, Grund-, Stamm-, Dotationskapital und Geschäftsguthaben) ohne kumulative Vorzugsaktien, von der BaFin anerkanntes freies Vermögen
0070	1.1.1.2	(-) Eigene Anteile oder Geschäftsanteile (ohne eigene kumulative Vorzugsaktien) sowie gekündigte Geschäftsguthaben und Geschäftsguthaben ausscheidender Genossen		siehe auch § 10 Abs. 2a Satz 1 Nr. 2 und 3 KWG
0080	1.1.1.3	Kapitalrücklage (Emissionsagiokonto)		
0091	1.1.1.4	Anderes Kapital gemäß § 10 Abs. 2a Satz 1 Nr. 8 KWG		Instrumente, welche die Anforderungen nach § 10 Abs. 2a Satz 1 Nr. 8 KWG nicht erfüllen und daher unter die Übergangsvorschrift nach § 64m Abs. 1 KWG fallen, sind unter 1.1.4.1a.04 oder 1.1.4.1a.05 auszuweisen.
0100	1.1.2	Sonstige anrechenbare Rücklagen		1.1.2.1+1.1.2.2+1.1.2.3+1.1.2.4a +1.1.2.4.b + 1.1.2.5+1.1.2.6 Der im zuletzt festgestellten Jahresabschluss ausgewiesene Bilanzgewinn bzw. Bilanzverlust ist hier schon berücksichtigt (Nettoausweis)
0110	1.1.2.1	Sonstige Rücklagen (aufsichtlich)		= 1.1.2.1.01 + 1.1.2.1.02 sonstige Rücklagen (ohne in Pos. 1.1.1.3 ausgewiesene Kapitalrücklage)
0111	1.1.2.1.01	Sonstige Rücklagen		Auszuweisen sind hier die der letzten festgestellten für den Schluss eines Geschäftsjahres festgestellten Bilanz ausgewiesenen Sonstigen Rücklagen nach § 10 Abs. 2a Satz 1 KWG i.V.m. § 10 Abs. 3a KWG
0112	1.1.2.1.02	Bereinigung um einen auf die Sonstigen Rücklagen entfallenden Anteil, der auf im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften beruht		

Blatt 1

**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

 Institutsnummer:  Prüzfiffer: 

 Name:  Ort: 

 Stand Ende:  Sachbearbeiter/in: 

 Telefon: 

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
			(a) 01	02
0120	1.1.2.2	<b>Anteile in Fremdbesitz (minority interest)</b>		=1.1.2.2.01+1.1.2.2.02+1.1.2.2.03
0141	1.1.2.2***01	darunter (nachrichtlich): Sonstiges Kapital, wandelbar in einer Belastungssituation		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 5 KWG
0142	1.1.2.2***02	darunter (nachrichtlich): Sonstiges Kapital, unbefristet und ohne Tilgungsanreize		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 4 KWG
0143	1.1.2.2***03	darunter (nachrichtlich): Sonstiges Kapital, befristet oder mit Tilgungsanreizen		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 3 KWG
0144	1.1.2.2***04	darunter (nachrichtlich): Begrenzt anrechenbare, einer Übergangsvorschrift unterliegende Kernkapitalinstrumente, unbefristet und ohne Tilgungsanreize		indirekt emittierte Instrumente ohne Tilgungsanreize, die nicht den Anforderungen des § 10 Abs. 4 KWG entsprechen und dennoch gemäß § 64m Abs. 1 KWG als Kernkapitalinstrumente angerechnet werden dürfen
0145	1.1.2.2***05	darunter (nachrichtlich): Begrenzt anrechenbare, einer Übergangsvorschrift unterliegende Kernkapitalinstrumente, befristet oder mit Tilgungsanreizen		indirekt emittierte Instrumente mit Tilgungsanreizen, die nicht den Anforderungen des § 10 Abs. 4 KWG entsprechen und dennoch gemäß § 64m Abs. 1 KWG als Kernkapitalinstrumente angerechnet werden dürfen
0146	1.1.2.2.01	Anteile in Fremdbesitz		
0147	1.1.2.2.02	Bereinigung um einen auf die Anteile in Fremdbesitz entfallenden Anteil, der auf im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften beruht		
0148	1.1.2.2.03	(-) Bestand an Anteilen in Fremdbesitz, welche nicht als Kernkapital berücksichtigungsfähig sind		
0150	1.1.2.3	<b>Zwischengewinn / Zwischenverlust (aufsichtlich)</b>		= 1.1.2.3.01+1.1.2.3.02.
0160	1.1.2.3.01	Zwischengewinn des laufenden Geschäftsjahres		<b>Auszuweisen ist hier der im Zwischenabschluss nach § 10 Abs. 3 KWG ausgewiesene Gewinn</b>
0170	1.1.2.3.02	Bereinigung um einen auf diesen Zwischengewinn entfallenden Anteil, der auf im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften beruht		

Blatt 2

**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>
Name:	<input type="text"/>	Ort:	<input type="text"/>
Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>
		Telefon:	<input type="text"/>

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0180	1.1.2.4a	<b>(-) Wesentliche Verluste des laufenden Geschäftsjahres, Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 3b KWG</b>		
0190	1.1.2.4a.01	Wesentliche Verluste des laufenden Geschäftsjahres, Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 3b KWG		da tendenziell Nettoausweis in Zeile 180 erfolgt, können Zeilen 190 und 200 auch b.a.w. entfallen
0200	1.1.2.4a.02	Bereinigung um einen auf diesen Verlust entfallenden Anteil, der auf im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften beruht		da tendenziell Nettoausweis in Zeile 180 erfolgt, können Zeilen 190 und 200 auch b.a.w. entfallen
0210	1.1.2.4b	<b>Zwischenverlust (aufsichtlich)</b>		= 1.1.2.4b.01+1.1.2.4b.02
0220	1.1.2.4b.01	(-) Zwischenverlust des laufenden Geschäftsjahres		<b>Auszuweisen ist hier der im Zwischenabschluss nach § 10 Abs. 3 KWG ausgewiesene Verlust</b>
0230	1.1.2.4b.02	Bereinigung um einen auf diesen Zwischenverlust entfallenden Anteil, der auf im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften beruht		
0240	1.1.2.5	<b>(-) Nettogewinne aus der Kapitalisierung künftiger Erträge verbriefter Forderungen</b>		§ 10 Abs. 3a Satz 4 KWG: Bei einem Institut, das Originator einer Verbriefungstransaktion ist, gelten die Nettogewinne aus der Kapitalisierung der künftigen Erträge der verbrieften Forderungen, die die Bonität von Verbriefungspositionen verbessern, nicht als Rücklagen im Sinne von Absatz 2a Satz 1
0250	1.1.2.6	<b>Im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften (Prudential Filters)</b>		<b>1.1.2.6.01 bis 1.1.2.6.14</b>
0260	1.1.2.6.01	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten		Ausweis erfolgt hier unter Berücksichtigung von Cash-Flow-Hedging nach § 5 Abs. 2 KonÜV
0270	1.1.2.6.02	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten		(§ 2 Abs.1 KonÜV i.V.m. § 5 Abs. 2 KonÜV)
0280	1.1.2.6.03	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Kredit und sonstigen Forderungen		
0290	1.1.2.6.04	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Kredit und sonstigen Forderungen		(§ 2 Abs. 3 KonÜV)
0300	1.1.2.6.05	Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögenswerten		Ausweis erfolgt hier unter Berücksichtigung von Cash-Flow-Hedging nach § 5 Abs. 2 KonÜV
0310	1.1.2.6.06	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögenswerten		(§ 2 Abs.1 KonÜV i.V.m. § 5 Abs. 2 KonÜV)
0320	1.1.2.6.07	Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf finanzielle Verbindlichkeiten (eigenes Kreditrisiko)		

**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>
Name:	<input type="text"/>	Ort:	<input type="text"/>
Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>
		Telefon:	<input type="text"/>

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0330	1.1.2.6.08	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf finanzielle Verbindlichkeiten (eigenes Kreditrisiko)		(§ 6 KonÜV)
0340	1.1.2.6.09	Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögenswerten dienen		
0350	1.1.2.6.10	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögenswerten dienen		(§ 5 Abs. 1 KonÜV)
0360	1.1.2.6.11	Bewertungseffekte aus als Finanzinvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden		
0370	1.1.2.6.12	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden		(§ 3 KonÜV)
0380	1.1.2.6.13	Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden		
0390	1.1.2.6.14	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden		(§ 3 KonÜV)
0400	1.1.2.6.15	Andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen		
0410	1.1.2.6.16	Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen		
0420	1.1.3	<b>Sonderposten für allgemeine Bankrisiken nach § 340g HGB</b>		
0430	1.1.4	<b>Andere und landesspezifische Kernkapitalbestandteile</b>		=1.1.4.1a+1.1.4.3+1.1.4.4
0451	1.1.4.1a	<b>Sonstiges Kapital</b>		=1.1.4.1a.01+1.1.4.1a.02+1.1.4.1a.03+1.1.4.1a.04+1.1.4.1a.05  Diese Position enthält nicht nur direkt emittierte, dem Sonstigen Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 3 bis 5 KWG zugeordnete Instrumente, sondern auch solche indirekt emittierten, dem Sonstigen Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 3 bis 5 KWG zugeordnete Instrumente, die jedoch nicht der Position 0120/01 zugerechnet werden, da es sich hier aus Sicht der Rechnungslegung um Verbindlichkeiten handelt.
0452	1.1.4.1a.01	Sonstiges Kapital, wandelbar in einer Belastungssituation		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 5 KWG
0453	1.1.4.1a.02	Sonstiges Kapital, unbefristet und ohne Tilgungsanreize		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 4 KWG
0454	1.1.4.1a.03	Sonstiges Kapital, befristet und mit Tilgungsanreizen		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 3 KWG
0455	1.1.4.1a.04	Begrenzt anrechenbare, einer Übergangsvorschrift unterliegende Kernkapitalinstrumente, unbefristet und ohne Tilgungsanreize		direkt emittierte Instrumente ohne Tilgungsanreize, die nicht den Anforderungen des § 10 Abs. 4 KWG entsprechen und dennoch gemäß § 64m Abs. 1 KWG als Kernkapitalinstrumente angerechnet werden dürfen

Blatt 4

**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>
Name:	<input type="text"/>	Ort:	<input type="text"/>
Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>
		Telefon:	<input type="text"/>

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0456	1.1.4.1a.05	Begrenzt anrechenbare, einer Übergangsvorschrift unterliegende Kernkapitalinstrumente, befristet oder mit Tilgungsanreizen		direkt emittierte Instrumente mit Tilgungsanreizen, die nicht den Anforderungen des § 10 Abs. 4 KWG entsprechen und dennoch gemäß § 64m Abs. 1 KWG als Kernkapitalinstrumente angerechnet werden dürfen
0460	1.1.4.3	<i>Korrekturposten (positiv) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften</i>		
0470	1.1.4.4	<i>Gesamtbetrag des aktivischen Unterschiedsbetrages gemäß § 10 a Abs. 6 Satz 9 und 10 KWG abzüglich mindestens 50% des Teilbetrages, der nicht wie eine Beteiligung an einem gruppenfremden Unternehmen behandelt wird</i>		
0480	1.1.5	(-) Sonstige Abzugspositionen vom Kernkapital		=1.1.5.1+1.1.5.2a+1.1.5.3a+1.1.5.4
0490	1.1.5.1	(-) Immaterielle Vermögensgegenstände		
0511	1.1.5.2a	(-) Abzugspositionen aus Überschreitung der Anrechnungsgrenzen des Sonstigen Kapitals		=1.1.5.2a.01+1.1.5.2a.02+1.1.5.2a.03+1.1.5.2a.04 Die Beträge aus der Überschreitung der Anrechnungsgrenzen gemäß § 10 Abs. 2 Satz 3 bis 5 sowie gemäß § 64m Abs. 1 und 2 KWG der in den Positionen 0141/01 bis 0145/01 sowie 0451/01 gemeldeten Kapitalbestandteile sind hier abzuziehen.
0512	1.1.5.2a.01	(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze nach § 10 Abs. 2 Satz 5 KWG		§ 10 Abs. 2 Satz 5 KWG
0513	1.1.5.2a.02	(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze nach § 10 Abs. 2 Satz 4 KWG		§ 10 Abs. 2 Satz 4 KWG
0514	1.1.5.2a.03	(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze nach § 10 Abs. 2 Satz 3 KWG		§ 10 Abs. 2 Satz 3 KWG
0515	1.1.5.2a.04	(-) Kernkapitalinstrumente, die den Übergangsvorschriften gemäß § 64m Abs. 1 KWG unterliegen		§ 64m Abs. 1 KWG, einzubeziehen sind hier die in den Positionen 0144/01 und 0145/01 sowie 0455/01 und 0456/01 gemeldeten Instrumente
0516	1.1.5.3a	(-) Korrekturposten für Bewertungsanpassungen gemäß § 1a Abs. 8 KWG, soweit nicht bereits in der Rechnungslegung berücksichtigt		siehe BaFin-Rundschreiben zu § 1a Abs. 8 KWG
0520	1.1.5.4	(-) Andere, landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital		=1.1.5.4.1+1.1.5.4.2
0530	1.1.5.4.1	(-) Korrekturposten (negativ) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften		

Blatt 5

**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Name:		Ort:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
		Telefon:	

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0540	1.1.5.4.2	(-) Entnahmen der/ Kredite an Gesellschafter, sowie der Überschuss der Aktivposten über die Passivposten bei Zweigstellen von Unternehmen mit Sitz im Ausland		Abzugsposten nach § 10 Abs. 2a Satz 2 Nr. 4 und 5 KWG
0550	1.2	<b>Ergänzungskapital</b>		=1.2.1+1.2.2+1.2.3
0560	1.2.1	<b>Ergänzungskapital 1. Klasse</b>		=1.2.1.1+1.2.1.2+1.2.1.3+1.2.1.4+1.2.1.5+1.2.1.6+1.2.1.7+1.2.1.8
0570	1.2.1.1	<b>Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestandteile</b>		Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestandteile gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 7a KWG (siehe Position 0511/01) = -1.1.5.2a
0580	1.2.1.2	<b>Korrekturposten für aus dem Kernkapital übertragene Bewertungseffekte (Prudential Filters)</b>		1.2.1.2.01 bis 1.2.1.2.05
0590	1.2.1.2.01	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.02 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben
0600	1.2.1.2.02	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögenswerten		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.06 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben
0610	1.2.1.2.03	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.12 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben.
0620	1.2.1.2.04	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.14 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben
0630	1.2.1.2.05	Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen		= x% von Position 1.1.2.6.16
0640	1.2.1.3	<b>Nicht realisierte Reserven in Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden sowie in notierten Wertpapieren, in Verbundunternehmen und Investmentanteilen</b>		
0650	1.2.1.4	<b>Freie Vorsorgereserven nach § 340f HGB</b>		
0660	1.2.1.5	<b>Rücklagen nach § 6b des ESTG aus der Veräußerung von Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden</b>		
0670	1.2.1.6	<b>Kapital gemäß § 10 Abs. 5 KWG (abzüglich Marktpflegeposition)</b>		
0680	1.2.1.7	<b>Berücksichtigungsfähiger Wertberichtigungsüberschuss für IRBA-Positionen gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 9 KWG</b>		
0690	1.2.1.8	<b>Kumulative Vorzugsaktien im Sinne des § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 2 KWG (abzgl. eigener kumulativer Vorzugsaktien)</b>		
0700	1.2.2	<b>Ergänzungskapital 2. Klasse</b>		=1.2.2.1+1.2.2.2+1.2.2.3+1.2.2.4+1.2.2.5



**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>
Name:	<input type="text"/>	Ort:	<input type="text"/>
Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>
		Telefon:	<input type="text"/>

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
			01	02
0710	1.2.2.1	Haftsummenzuschlag		
0720	1.2.2.2	Kumulative Vorzugsaktien mit fester Laufzeit		
0730	1.2.2.3	Längerfristige nachrangige Verbindlichkeiten (abzüglich Marktpflegeposition)		
0740	1.2.2.4	Landesspezifische Ergänzungskapitalbestandteile 2. Klasse		
0750	1.2.2.5	(-) Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 2 Satz 7 KWG		§ 10 Abs. 2 Satz 7 KWG: Dabei darf das berücksichtigte Ergänzungskapital nur bis zu 50% des Kernkapitals aus längerfristigen nachrangigen Verbindlichkeiten und dem Haftsummenzuschlag bestehen.
0760	1.2.3	(-) Abzugspositionen von der Summe des Ergänzungskapitals		=1.2.3.1+1.2.3.2
0770	1.2.3.1	(-) Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 2 Satz 6 KWG		§ 10 Abs. 2 Satz 6 KWG: Bei der Berechnung des haftenden Eigenkapitals kann Ergänzungskapital nur bis zur Höhe des Kernkapitals berücksichtigt werden.
0780	1.2.3.2	(-) Sonstige im Ergänzungskapital zu berücksichtigende Abzugspositionen		1.2.3.2.1 + 1.2.3.2.2
0790	1.2.3.2.1	(-) Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 i.V.m. Abs. 3b KWG;		
0800	1.2.3.2.2	(-) Maximal 50% des aktivischen Unterschiedsbetrages gemäß § 10 a Abs. 6 Satz 9 und 10 KWG, der nicht wie eine Beteiligung an einem fremden Unternehmen behandelt wird		
0810	1.3	(-) Abzugspositionen vom Kern- und Ergänzungskapital		1.3.1 bis 1.3.11 Die Abzüge erfolgen zumindest zu 50% vom Kernkapital und höchstens zu 50% vom Ergänzungskapital
0820	1.3.T1*	davon: (-) Vom Kernkapital		Der sich gegebenenfalls ergebende negative Ergänzungskapitalsaldo nach § 10 Abs. 2a Satz 2 Nr. 7 KWG ist vom Kernkapital abzuziehen und hier zu berücksichtigen.
0830	1.3.T2*	davon: (-) Vom Ergänzungskapital		Sofern 50% des Betrages der Pos. 1.3 den Betrag von Pos. 1.2 übersteigt, so ist dieser negative Ergänzungskapitalsaldo (§ 10 Abs. 2a Satz 2 Nr. 7 KWG) vom Kernkapital abzuziehen, was durch Berücksichtigung in Pos. 1.3.T1* erfolgt.
0840	1.3.1	(-) Beteiligungen gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 1 KWG		
0850	1.3.2	(-) Forderungen aus nachrangigen Verbindlichkeiten und Kapitalgewährungen nach § 10 Abs. 5 KWG sowie Kapitalgewährungen nach § 10 Abs. 2a Satz 1 Nrn. 8 und 10 KWG gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 2 und 3 KWG		

Blatt 7

**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>
Name:	<input type="text"/>	Ort:	<input type="text"/>
Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>
		Telefon:	<input type="text"/>

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0860	1.3.3	(-) Beteiligungen, Forderungen aus nachrangigen Verbindlichkeiten und Kapitalgewährungen nach § 10 Abs. 5 KWG sowie Kapitalgewährungen nach § 10 Abs. 2a Satz 1 Nrn. 8 und 10 KWG gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 4 Buchstabe a bis c KWG		
0870	1.3.4	(-) Beteiligungen gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 5 KWG		
0880	1.3.5	(-) Forderungen aus nachrangigen Verbindlichkeiten und Genussrechten gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 6 KWG		
0890	1.3.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Kern- und Ergänzungskapital		
0900	1.3.LE	<i>nachrichtlich:</i> <i>Haftendes Eigenkapital nach § 10 Abs. 1d Satz 3 KWG (Bemessungsgrundlage für die Großkreditgrenze im Anlagebuch, für qualifizierte Beteiligungen außerhalb des Finanzsektors sowie für Organkredite)</i>		=1.1+(1.2-1.2.1.7)+1.3.1+1.3.2+1.3.3+1.3.4+1.3.5+1.3.6
0910	1.3.7	(-) Verbriefungspositionen, auf die ein Risikogewicht von 1250% angewandt wird und die bei der Ermittlung der risikogewichteten Aktiva oder bei der Ermittlung des Teilanrechnungsbetrags für das besondere Kursrisiko Zinsnettoposition nicht berücksichtigt worden sind		
0920	1.3.8	(-) Wertberichtigungsfehlbeträge und erwartete Verlustbeträge für IRBA-Positionen gemäß § 10 Abs. 6a Nr. 1 und Nr. 2 KWG		
0930	1.3.9	(-) Qualifizierte Beteiligungen nach § 12 KWG		
0940	1.3.10	(-) Abzugsposition gemäß § 10 Abs. 6a Nr. 4 KWG		
0950	1.3.11	(-) Großkreditüberschreitungen des Anlagebuches sowie Unterlegungsbeträge für Organkredite nach § 15 KWG		Großkreditüberschreitungen des Anlagebuches nach § 13 oder § 13a Abs. 3 KWG sowie Unterlegungsbeträge für Organkredite nach § 15 KWG
0960	1.4	<b>Kernkapital (gesamt) für Solvenzzwecke</b>		=1.1+1.3.T1* Darüber hinaus sind hier die Beträge aus Pos. 1.7 als Abzugspositionen zu erfassen, die mit Kernkapital unterlegt werden.
0970	1.5	<b>Ergänzungskapital (gesamt) für Solvenzzwecke</b>		=1.2+1.3.T2* Darüber hinaus sind hier die Beträge aus Pos. 1.7 als Abzugspositionen zu erfassen, die mit Ergänzungskapital unterlegt werden.
0980	1.6	<b>Genutzte, verfügbare Drittrangmittel</b>		=1.6.1+1.6.2+1.6.3+1.6.4+1.6.5+1.6.6+1.6.7

Blatt 8

**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>
Name:	<input type="text"/>	Ort:	<input type="text"/>
Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>
		Telefon:	<input type="text"/>

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0990	1.6.1	Positionen gemäß § 10 Abs. 2c Satz 1 Nr. 3 KWG		§ 10 Abs. 2c Nr. 3 KWG: Positionen, die allein wegen einer Kappung nach Absatz 2 Satz 6 und 7 nicht als Ergänzungskapital berücksichtigt werden können.
1000	1.6.2	Nettogewinn		
1010	1.6.3	Kurzfristige nachrangige Verbindlichkeiten (abzüglich Marktpflegeposition)		
1020	1.6.4	(-) Schwer realisierbare Aktiva sowie Verluste von Tochterunternehmen gemäß § 10 Abs. 2c Satz 4 KWG		
1030	1.6.5	(-) Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 2c Satz 2 und 3 KWG		Dritrangmittel + freies EK < 2,5 x FKK (Satz 2) bzw. 2 x FKK (Satz 3)
1040	1.6.LE	nachrichtlich: Eigenmittel für die Großkreditgrenze im Gesamtbuch		=1.3.LE+1.6.1+1.6.2+1.6.3+1.6.4+1.6.5
1050	1.6.6	Berücksichtigung sonstiger Positionen bei der Berechnung der genutzten, verfügbaren Dritrangmittel		1.6.6.1
1060	1.6.6.1	(-) Großkredit-Überschreitungen aus kreditnehmerbezogenen Handelsbuch- und Gesamtbuchpositionen, soweit sie mit Dritrangmitteln unterlegt werden		
1080	1.6.7	(-) Ungenutzte, aber verfügbare Dritrangmittel		
1090	1.7	(-) Abzüge von der Summe des haftenden Eigenkapitals		1.7.1 + 1.7.2
1100	1.7.1	(-) Großkredit-Überschreitungen aus kreditnehmerbezogenen Handelsbuch- und Gesamtbuchpositionen, die mit haftendem Eigenkapital unterlegt werden		Handelsbuchinstitute erfassen hier den Teil der Großkredit-Überschreitungen aus kreditnehmerbezogenen Handelsbuch- und Gesamtbuchpositionen (§ 13a Abs. 4 und Abs. 5 KWG), der mit haftendem Eigenkapital unterlegt wird.
1110	1.7.2	Beteiligungen an Versicherungsunternehmen		
1120	1.8 1.8.1	nachrichtlich: IRB-Wertberichtigungsüberschuss (+) / -fehlbetrag (-)		=1.8.1.1+1.8.1.2
1130	1.8.1.1	für IRB-Positionen gebildete Wertberichtigungen		
1140	1.8.1.1*	davon: Pauschalwertberichtigungen		
1150	1.8.1.1**	davon: Einzelwertberichtigungen		
1160	1.8.1.1***	davon: Vorsorgereserven nach § 340 f HGB		
1170	1.8.1.2	(-) Erwartete Verlustbeträge für IRB-Positionen		

Blatt 9

**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Name:		Ort:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
		Telefon:	

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
1180	1.8.2	<i>Bruttobetrag der längerfristigen nachrangigen Verbindlichkeiten</i>		
1190	1.8.3	<i>Mindestanfangskapital</i>		
1200	2	Eigenmittelanforderungen		=2.1+2.2+2.3+2.4+2.5+2.6 davon nach Zeile 2a: Max [2.1+2.2+2.3+2.6, 2.5] davon nach Zeile 2b: = 2.1+2.2+2.3+2.5+2.6 davon nach Zeile 2c: = 2.1 + 2.2 + 2.3 + Min[2.4, (12/88)*max(2.1+2.2+2.3, 2.5)] + 2.6; bei Anwendung von § 339 Abs. 7 Satz 2 Nr. 2 SolvV ist § 339 Abs. 7 Satz 3 SolvV zu berücksichtigen
1210	2a	<i>darunter: Eigenmittelanforderungen nach § 2 Abs. 4 SolvV bei Finanzdienstleistungsinstituten</i>		Max [2.1+2.2+2.3+2.6, 2.5]
1220	2b	<i>darunter: Eigenmittelanforderungen bei Anwendung von § 269 Abs. 3 SolvV bei Finanzdienstleistungsinstituten</i>		2.1+2.2+2.3+2.5+2.6
1230	2c	<i>darunter: Eigenmittelanforderungen bei Anwendung der Übergangsregelung nach § 339 Abs. 7 Satz 2 und 3 SolvV bei Finanzdienstleistungsinstituten, die nicht unter den Anwendungsbereich des § 269 Abs. 3 SolvV fallen</i>		"= 2.1 + 2.2 + 2.3 + Min[2.4, (12/88)*max(2.1+2.2+2.3, 2.5)] + 2.6; bei Anwendung von § 339 Abs. 7 Satz 2 Nr. 2 SolvV ist § 339 Abs. 8 Satz 3 SolvV zu berücksichtigen
1240	2.1	<i>Eigenkapitalanforderungen (gesamt) für Adressenausfallrisiken</i>		=2.1.1+2.1.2
1250	2.1.1	Kreditrisiko-Standardansatz (KSA)		=2.1.1.1a +2.1.1.2
1260	2.1.1.1a	<i>KSA-Forderungsklassen (ohne Verbriefungen)</i>		Anlage 3 Nr. 2 Zelle 010/ 22
1270	2.1.1.1a.01	Zentralregierungen		Anlage 3 Nr. 3 Zelle 010/ 22
1280	2.1.1.1a.02	Regionalregierungen und örtliche Gebietskörperschaften		Anlage 3 Nr. 4 Zelle 010/ 22
1290	2.1.1.1a.03	sonstige öffentliche Stellen		Anlage 3 Nr. 5 Zelle 010/ 22
1300	2.1.1.1a.04	multilaterale Entwicklungsbanken		Anlage 3 Nr. 6 Zelle 010/ 22
1310	2.1.1.1a.05	Internationale Organisationen		Anlage 3 Nr. 7 Zelle 010/ 22
1320	2.1.1.1a.06	Institute		Anlage 3 Nr. 8 Zelle 010/ 22
1330	2.1.1.1a.07	Unternehmen		Anlage 3 Nr. 10 Zelle 010/ 22
1340	2.1.1.1a.08	Mengengeschäft		Anlage 3 Nr. 11 Zelle 010/ 22
1350	2.1.1.1a.09	durch Immobilien besicherte Positionen		Anlage 3 Nr. 12 Zelle 010/ 22
1360	2.1.1.1a.10	überfällige Positionen		Anlage 3 Nr. 16 Zelle 010/ 22
1370	2.1.1.1a.11	Beteiligungen		Anlage 3 Nr. 14 Zelle 010/ 22
1380	2.1.1.1a.12	von Kreditinstituten emittierte gedeckte Schuldverschreibungen		Anlage 3 Nr. 9 Zelle 010/ 22
1390	2.1.1.1a.13	kurzfristige Forderungen an Unternehmen (sind in der Forderungskategorie "Unternehmen" mit aufzuführen)		
1400	2.1.1.1a.14	Investmentanteile		Anlage 3 Nr. 13 Zelle 010/ 22
1410	2.1.1.1a.15	sonstige Positionen		Anlage 3 Nr. 15 Zelle 010/ 22

Blatt 10

**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>
Name:	<input type="text"/>	Ort:	<input type="text"/>
Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>
		Telefon:	<input type="text"/>

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
			01	02
1420	2.1.1.1b	<b>IRBA-Forderungsklassen (ohne Verbriefungen)</b>		
1430	2.1.1.1b.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		
1440	2.1.1.1b.02	Institute		
1450	2.1.1.1b.03	Unternehmen		
1460	2.1.1.1b.04	Mengengeschäft		
1470	2.1.1.1b.05	Beteiligungen		
1480	2.1.1.1b.06	Sonstige kreditunabhängige Aktiva		
1490	2.1.1.2	<b>KSA-Verbriefungstransaktionen</b>		Anlage 3 Nr. 17 Zelle 010/33
1491	2.1.1.2*	<b>darunter: Wiederverbriefungen</b>		Anlage 3 Nr. 17 Zelle 011/33
1500	2.1.2	<b>Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRBA)</b>		=2.1.2.1+2.1.2.2+2.1.2.3+2.1.2.4+2.1.2.5
1510	2.1.2.1	<b>IRB-Ansatz, wenn eigene Schätzungen weder für die Ermittlung der Verlustquote bei Ausfall noch für IRBA-Konversionsfaktoren genutzt werden</b>		2.1.2.1.01 bis 2.1.2.1.03 Anlage 3 Nr. 18a Zelle 010/24
1520	2.1.2.1.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		Anlage 3 Nr. 19a Zelle 010/ 24
1530	2.1.2.1.02	Institute		Anlage 3 Nr. 20a Zelle 010/ 24
1540	2.1.2.1.03	Unternehmen		Anlage 3 Nr. 22a Zelle 010/ 24
1550	2.1.2.2	<b>IRB-Ansatz, wenn eigene Schätzungen für die Ermittlung der Verlustquote bei Ausfall und/oder der IRBA-Konversionsfaktoren genutzt werden</b>		2.1.2.2.01 bis 2.1.2.2.04 Anlage 18 Zelle 010/24
1560	2.1.2.2.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		Anlage 3 Nr. 19 Zelle 010/ 24
1570	2.1.2.2.02	Institute		Anlage 3 Nr. 20 Zelle 010/ 24
1580	2.1.2.2.03	Unternehmen		Anlage 3 Nr. 22 Zelle 010/ 24
1590	2.1.2.2.04	Mengengeschäft		Anlage 3 Nr. 21 Zelle 010/ 24
1600	2.1.2.3	<b>Beteiligungen</b>		Anlage 3 Nr. 24 Zelle 010/ 13
1610	2.1.2.4	<b>IRBA-Verbriefungspositionen</b>		Anlage 3 Nr. 25 Zelle 010/ 39
1611	2.1.2.4*	<b>darunter: Wiederverbriefungen</b>		Anlage 3 Nr. 25 Zelle 011/ 39
1620	2.1.2.5	<b>Sonstige kreditunabhängige Aktiva</b>		keine Verknüpfung mit einem anderen Meldebogen
1630	2.2	<b>Abwicklungsrisiken</b>		2.2.1 und 2.2.2
1631	2.2.1	<b>Abwicklungsrisiken im Anlagebuch</b>		Anlage 3 Nr. 27 Zelle 011/ 03
1632	2.2.2	<b>Abwicklungsrisiken im Handelsbuch</b>		Anlage 3 Nr. 27 Zelle 070/03
1640	2.3	<b>Eigenmittelanforderungen für Marktrisikopositionen</b>		2.3.1 und 2.3.2
1650	2.3.1	<b>Eigenmittelanforderungen für die Marktrisikopositionen nach den Standardverfahren</b>		2.3.1.1 bis 2.3.1.4
1660	2.3.1.1	<b>Zinsnettoposition</b>		2.3.1.1.01 bis 2.3.1.1.03 Darüber hinaus sind hier die Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach der Szenario Matrix Methode zu erfassen
1661	2.3.1.1.01	<b>Allgemeines und besonderes Kursrisiko Zinsnettoposition</b>		Anlage 3 Nr. 32 Zellen 300/01, 400/05 und 520/03
1662	2.3.1.1.02	<b>Besonderes Kursrisiko Verbriefungspositionen im Handelsbuch</b>		Anlage 3 Nr. 68 Zelle 010/61
1663	2.3.1.1.03	<b>Besonderes Kursrisiko Correlation Trading Portfolio</b>		Anlage 3 Nr. 69 Zelle 010/45
1670	2.3.1.2	<b>Aktiennettoposition</b>		Anlage 3 Nr. 33 Zelle 090/07. Darüber hinaus sind hier die Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach der Szenario Matrix Methode zu erfassen

Blatt 11

**1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Name:		Ort:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
		Telefon:	

in Tsd Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
1680	2.3.1.3	<i>Währungsgesamtposition</i>		Anlage 3 Nr. 30 Zelle 99001. Darüber hinaus sind hier die Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach der Szenario Matrix Methode zu erfassen
1690	2.3.1.4	<i>Rohwarenposition</i>		Anlage 3 Nr. 31 Zelle 350/03. Darüber hinaus sind hier die Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach der Szenario Matrix Methode zu erfassen
1700	2.3.2	Eigenmittelanforderungen für die Marktrisikopositionen bei Verwendung eines eigenen Risikomodells		Anlage 3 Nr. 29 Zelle 010/05
1710	2.4	Eigenkapitalanforderungen für das operationelle Risiko		=2.4.1+2.4.2+2.4.3
1720	2.4.1	Basisindikatoransatz		Anlage 3 Nr. 28 Zelle 010/07
1730	2.4.2	Standardansatz/alternativer Standardansatz		Anlage 3 Nr. 28 Zelle 020/07
1740	2.4.3	Fortgeschrittene Messansätze		Anlage 3 Nr. 28 Zelle 130/07
1750	2.5	Verwaltungskostenbasierte Eigenmittelanforderung gemäß § 10 Abs. 9 Satz 1 und 2 KWG		
1760	2.6	Sonstige oder übergangsweise Eigenkapitalanforderungen		2.6.2 + 2.6.3
1770	2.6.1	Zusätzliche Eigenkapitalanforderungen aufgrund der Regelung in § 339 Abs. 5a und 5b SolvV		
1780	2.6.2	Zusätzliche Eigenkapitalanforderungen aufgrund der Regelung in § 339 Abs. 7 Satz 4 SolvV		
1790	2.6.3	Eigenmittelanforderungen für "Andere Marktrisikopositionen"		Keine Verknüpfung mit einem anderen Meldebogen; einzutragen sind hier die nach § 312 SolvV zu ermittelnden Eigenmittelanforderungen für andere Marktrisikopositionen. Darüber hinaus sind hier die Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach der Szenario Matrix Methode zu erfassen
	3	Nachrichtlich:		
1800	3.1	Überschuss (+) / Defizit (-) der Eigenmittel vor sonstigen und übergangsweise Eigenkapitalanforderungen		=1-(2 - 2.6)
1810	3.1a	Gesamtkennziffer (%) vor sonstigen und übergangsweise Eigenkapitalanforderungen		=1/ (2 - 2.6) * 8
1820	3.2	Überschuss (+) / Defizit (-) der Eigenmittel		=1-2
1830	3.2.a	Gesamtkennziffer (%)		=1 / 2 * 8
1840	3.3	Überschuss (+) / Defizit (-) der Eigenmittel unter Berücksichtigung des SRP		
1850	3.3a	Gesamtkennziffer als Index (%) unter Berücksichtigung des SRP		
1860	3.4	Interne Einschätzung der Risikotragfähigkeit: Überschüsse (+) / Defizit (-) des internen Kapitals		
1870	3.4.1	Risikodeckungspotential		
1880	3.4.2	Interne Einschätzung der Kapitalanforderungen		
(a) Jeder Betrag, der die Eigenmittel oder die Eigenmittelanforderungen erhöht, hat ein positives Vorzeichen; Jeder Betrag, der die Eigenmittel oder die Eigenmittelanforderungen reduziert, hat ein negatives Vorzeichen.				

## 2. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA ES  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

Summenblatt (Anlage 3  
Nr. 3 - 16)

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand:

Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

					Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekte bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
					Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Substitutionseffekte		
					Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode		(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge
					05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10
										11=04+09+10
010	Gesamtsumme	01	02	03	04=01+03					
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position										
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten										
070	0%									
080	10%									
090	20%									
100	35%									
110	50%									
120	darunter: Überfällige Positionen									
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
145	70%									
150	75%									
160	100%									
170	darunter: Überfällige Positionen									
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
200	150%									
210	darunter: Überfällige Positionen									
220	200%									
230	Sonstige Risikogewichte									

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 2. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

**KSA ES**  
Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

Summenblatt  
(Anlage 3 Nr. 3 - 16)

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsstärker für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeibereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsstärker für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
						0%	20%	50%	100%			
						12	13	14	15=11+12+13			
010	<b>Gesamtsumme</b>											Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											



## 3. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E1  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

Zentralregierungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge		Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	
					Garantien	Kreditderivate					
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 3. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E1

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

Zentralregierungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	
			0%	20%	50%	100%				
										12
010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldebogen
	<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>									
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
	<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>									
070	0%									
080	10%									
090	20%									
100	35%									
110	50%									
120	darunter: Überfällige Positionen									
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
145	70%									
150	75%									
160	100%									
170	darunter: Überfällige Positionen									
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
200	150%									
210	darunter: Überfällige Positionen									
220	200%									
230	Sonstige Risikogewichte									

## 4. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E2  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

Regionalregierungen  
und örtliche Gebiets-  
körperschaften

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Werberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Werberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) genannten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge	Berücksicht- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen; Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge		
										Garantien	
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV										
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen										
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitsnachsüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV										
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV										
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV										
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten											
070	0%										
080	10%										
090	20%										
100	35%										
110	50%										
120	darunter: Überfällige Positionen										
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen										
145	70%										
150	75%										
160	100%										
170	darunter: Überfällige Positionen										
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
190	Durch Immobilien besicherte Positionen										
200	150%										
210	darunter: Überfällige Positionen										
220	200%										
230	Sonstige Risikogewichte										

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode,  
Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

#### 4. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E2

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

Regionalregierungen und  
örtliche  
Gebietskörperschaften

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	
			0%	20%	50%	100%				
										12
1010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
1020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
1030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen									
1040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
1050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
1060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
1070	0%									
1080	10%									
1090	20%									
1100	35%									
1110	50%									
1120	darunter: Überfällige Positionen									
1130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
1140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
1145	70%									
1150	75%									
1160	100%									
1170	darunter: Überfällige Positionen									
1180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
1190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
1200	150%									
1210	darunter: Überfällige Positionen									
1220	200%									
1230	Sonstige Risikogewichte									

## 5. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E3  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

sonstige öffentliche  
Stellen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge		
										Garantien	
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode,  
Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 5. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E3  
Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

sonstige öffentliche  
Stellen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	
			0%	20%	50%	100%				
										12
010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
070	0%									
080	10%									
090	20%									
100	35%									
110	50%									
120	darunter: Überfällige Positionen									
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
145	70%									
150	75%									
160	100%									
170	darunter: Überfällige Positionen									
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
200	150%									
210	darunter: Überfällige Positionen									
220	200%									
230	<b>Sonstige Risikogewichte</b>									

## 6. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E4  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

multilaterale  
Entwicklungsbanken

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge		
										Garantien	
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitsnachsüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode,  
Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 6. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E4  
Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

multilaterale  
Entwicklungsbanken

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	
			0%	20%	50%	100%				
										12
010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
070	0%									
080	10%									
090	20%									
100	35%									
110	50%									
120	darunter: Überfällige Positionen									
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
145	70%									
150	75%									
160	100%									
170	darunter: Überfällige Positionen									
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
200	150%									
210	darunter: Überfällige Positionen									
220	200%									
230	Sonstige Risikogewichte									



## 7. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E5  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

internationale  
Organisationen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge		
										Garantien	
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode,  
Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 7. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E5

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

internationale  
Organisationen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen (§ 24 SolvV)	
			0%	20%	50%	100%				
										12
010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
070	0%									
080	10%									
090	20%									
100	35%									
110	50%									
120	darunter: Überfällige Positionen									
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
145	70%									
150	75%									
160	100%									
170	darunter: Überfällige Positionen									
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
200	150%									
210	darunter: Überfällige Positionen									
220	200%									
230	Sonstige Risikogewichte									

## 8. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E6  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

Institute

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	
					Garantien	Kreditderivate					
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode,  
Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 8. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E6

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

Institute

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	
			0%	20%	50%	100%				
										12
010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
070	0%									
080	10%									
090	20%									
100	35%									
110	50%									
120	darunter: Überfällige Positionen									
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
145	70%									
150	75%									
160	100%									
170	darunter: Überfällige Positionen									
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
200	150%									
210	darunter: Überfällige Positionen									
220	200%									
230	Sonstige Risikogewichte									

## 9. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E7  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

von Kreditinstituten  
emittierte gedeckte  
Schuldverschreibungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen						KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten	
				Substitutionseffekte				Substitutionseffekte		Gesamtsumme der Zugänge	Gesamtsumme der Abgänge
				Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge				Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge			
				Garantien	Kreditderivate	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	(-) Gesamtsumme der Abgänge	(-) Gesamtsumme der Zugänge		
01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10	
<b>010 Gesamtsumme</b>											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>											
<b>020 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV</b>											
<b>030 Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen</b>											
<b>040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV</b>											
<b>050 Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV</b>											
<b>060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV</b>											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>											
070	0%										
080	10%										
090	20%										
100	35%										
110	50%										
120	darunter: Überfällige Positionen										
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen										
145	70%										
150	75%										
160	100%										
170	darunter: Überfällige Positionen										
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
190	Durch Immobilien besicherte Positionen										
200	150%										
210	darunter: Überfällige Positionen										
220	200%										
230	Sonstige Risikogewichte										

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 9. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E7

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

von Kreditinstituten  
emittierte gedeckte  
Schuldverschreibungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (\$ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen			
			Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwundfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente	0%				20%	50%	100%
						12				13	14	15=11+12 + 13
010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldbogen		
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>												
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

## 10. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E8

Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

Unternehmen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand

Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge		
										Garantien	
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 10. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E8

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

Unternehmen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	
			0%	20%	50%	100%				
										12
010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
070	0%									
080	10%									
090	20%									
100	35%									
110	50%									
120	darunter: Überfällige Positionen									
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
145	70%									
150	75%									
160	100%									
170	darunter: Überfällige Positionen									
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
200	150%									
210	darunter: Überfällige Positionen									
220	200%									
230	Sonstige Risikogewichte									



## 11. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E9  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

Mengengeschäft

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen		Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)		(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) genannten KSA-Positionen gebildet wurden		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)		Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen						KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten			
										Substitutionseffekte		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten				Berücksichtigungsfähige Sicherheiten	
										(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen, Inkongruenzbereinigte Beträge	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Kreditderivate			Garantien	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzbereinigte Beträge
		01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10							
010	Gesamtsumme																		
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position																			
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV																		
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																		
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV																		
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV																		
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV																		
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten																			
070	0%																		
080	10%																		
090	20%																		
100	35%																		
110	50%																		
120	darunter: Überfällige Positionen																		
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur																		
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen																		
145	70%																		
150	75%																		
160	100%																		
170	darunter: Überfällige Positionen																		
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur																		
190	Durch Immobilien besicherte Positionen																		
200	150%																		
210	darunter: Überfällige Positionen																		
220	200%																		
230	Sonstige Risikogewichte																		

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

11. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E9  
Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

Mengeschäft

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominierungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominierungstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolV				KSA-Positionswert nach § 48 SolV	Risikogewicht der KSA-Positionswert (§ 24 SolV)	Eigenkapitalanforderungen
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente		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
010	Gesamtsumme											Übertrag UB Meldebogen
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitenzuschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

## 12. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E10  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

durch Immobilien  
besicherte  
Positionen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand:

Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen						KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Substitutionseffekte		
					Garantien	Kreditderivate			(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode,  
Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 12. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E10

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

durch Immobilien  
besicherte Positionen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	
			0%	20%	50%	100%				
										12
010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
070	0%									
080	10%									
090	20%									
100	35%									
110	50%									
120	darunter: Überfällige Positionen									
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
145	70%									
150	75%									
160	100%									
170	darunter: Überfällige Positionen									
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
200	150%									
210	darunter: Überfällige Positionen									
220	200%									
230	Sonstige Risikogewichte									

## 13. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E11

Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

Investmentanteile

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand

Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge		Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	
					Garantien	Kreditderivate					
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10	11=04+09+10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 13. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E11

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

Investmentanteile

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen		
			0%	20%	50%	100%					
	Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwundfaktor (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente	15=11+12 + 13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	<b>Gesamtsumme</b>										Übertrag UB Meldebogen
	<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV										
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen										
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV										
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV										
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV										
	<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
070	0%										
080	10%										
090	20%										
100	35%										
110	50%										
120	darunter: Überfällige Positionen										
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen										
145	70%										
150	75%										
160	100%										
170	darunter: Überfällige Positionen										
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
190	Durch Immobilien besicherte Positionen										
200	150%										
210	darunter: Überfällige Positionen										
220	200%										
230	Sonstige Risikogewichte										

## 14. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E12  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

Beteiligungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge		
										Garantien	
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode,  
Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 14. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E12

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

Beteiligungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	
			0%	20%	50%	100%				
										12
010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
070	0%									
080	10%									
090	20%									
100	35%									
110	50%									
120	darunter: Überfällige Positionen									
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
145	70%									
150	75%									
160	100%									
170	darunter: Überfällige Positionen									
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
200	150%									
210	darunter: Überfällige Positionen									
220	200%									
230	Sonstige Risikogewichte									



## 15. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E13  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

sonstige Positionen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand

Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge		
										Garantien	
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10	11=04+09+10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 15. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E13

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

sonstige Positionen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	
			0%	20%	50%	100%				
										12
010	<b>Gesamtsumme</b>									Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV									
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV									
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV									
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV									
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
070	0%									
080	10%									
090	20%									
100	35%									
110	50%									
120	darunter: Überfällige Positionen									
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen									
145	70%									
150	75%									
160	100%									
170	darunter: Überfällige Positionen									
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur									
190	Durch Immobilien besicherte Positionen									
200	150%									
210	darunter: Überfällige Positionen									
220	200%									
230	<b>Sonstige Risikogewichte</b>									

## 16. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E14

Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

überfällige  
Positionen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen						KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Substitutionseffekte		
					Garantien	Kreditderivate			(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010 Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030 Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050 Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten											
070 0%											
080 10%											
090 20%											
100 35%											
110 50%											
120 darunter: Überfällige Positionen											
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145 70%											
150 75%											
160 100%											
170 darunter: Überfällige Positionen											
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 150%											
210 darunter: Überfällige Positionen											
220 200%											
230 Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

## 16. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen

KSA E14

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

überfällige Positionen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen		
			0%	20%	50%	100%					
	Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwundfaktor (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente	15=11+12 + 13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	<b>Gesamtsumme</b>										Übertrag UB Meldebogen
	<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV										
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen										
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV										
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV										
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV										
	<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>										
070	0%										
080	10%										
090	20%										
100	35%										
110	50%										
120	darunter: Überfällige Positionen										
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen										
145	70%										
150	75%										
160	100%										
170	darunter: Überfällige Positionen										
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
190	Durch Immobilien besicherte Positionen										
200	150%										
210	darunter: Überfällige Positionen										
220	200%										
230	Sonstige Risikogewichte										

# 17. Meldung über KSA-Positionen

KSA EV  
Blatt 1

KSA-Forderungsklasse:

Verbriefungen

Institutsnummer:

Prüfziffer

Name:

Verbriefungsart:

Summenblatt

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Gesamtbeitrag der erzeugten Verbriefungspositionen	Synthetische Verbriefung: Auf das verbrieft Portfolio angewandte Kreditrisikominderungs-techniken			Verbriefungs- positionen	(-) Werberichtungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (5) KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken und zzgl. Werberichtungen und Rückstellungen	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 238 SotVV)	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten auf die KSA-Bemessungsgrundlage				
			(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsbereinigende Beträge (a)	(-) Abgänge insgesamt	Um Währungsin Kongruenzen bereinigte berücksichtigungsfähige Garantien und Krediterivate				Berücksichtigungsfähige Garantien und Krediterivate: Inkongruenzbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten sowie als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzbereinigte Beträge	Substitutionseffekte durch Anwendung von Kreditrisikominderungs-techniken auf die KSA-Bemessungs- grundlage	Zuflüsse insgesamt	
													01
010	Gesamtsumme												
011	darunter: Wiederverbriefungspositionen												
020	Originator: Gesamtengagement												
030	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
031	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen												
032	Wiederverbriefungspositionen												
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen												
071	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen												
072	Wiederverbriefungspositionen												
080	Vorzeitige Tilgung												
090	Investor: Gesamtengagement												
091	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist												
100	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
101	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen												
102	Wiederverbriefungspositionen												
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen												
141	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen												
142	Wiederverbriefungspositionen												
150	Sponsor: Gesamtengagement												
160	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen												

(a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche

# 17. Meldung über KSA-Positionen

KSA EV

Blatt 2

KSA-Forderungsklasse:

Verbriefungsart:

Verbriefungen

Summenblatt

Institutsnummer:

Prüf-

ziffer:

Name:

Ort:

Stand

Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		KSA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungsstechniken	Aufgliederung der KSA-Bemessungsgrundlage aus Spalte (14) von außerbilanziellen Positionen nach KSA-Konversionsfaktoren				KSA-Positionswert (§ 239 SolV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 267 SolV)	KSA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugspositionen	21=19+20
				0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%				
		12 = 07+10+11	13	14	15	16	17	18	19	20	
010	Gesamtsumme										
011	darunter: Wiederverbriefungspositionen										
020	Originator: Gesamtengagement										
030	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen										
031	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen										
032	Wiederverbriefungspositionen										
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen										
071	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen										
072	Wiederverbriefungspositionen										
080	Vorzeitige Tilgung										
090	Investor: Gesamtengagement										
091	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist										
100	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen										
101	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen										
102	Wiederverbriefungspositionen										
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen										
141	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen										
142	Wiederverbriefungspositionen										
150	Sponsor: Gesamtengagement										
160	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen										
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen										

# 17. Meldung über KSA-Positionen

KSA EV  
Blatt 3

KSA-Forderungsklasse:  
Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt
Ort:

Institutsnummer:	Prüfziffer:
Stand Ende:	Sachbearbeiter/in:

Name:
Telefon:

in Tsd Euro

		Aufgliederung der KSA-Positionswerte nach Risikogewichten												Riskogewichteter KSA-Positionswert ( § 240 SolV)	Zuschlag zum riskogewichteten KSA-Positionswert (§ 240 SolV) bei Verstoß gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)	Zuschlagsbetrag auf den riskogewichteten KSA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von KSA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Nachrichtlich: Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Aggregierte Kapitalanforderungen
		Mit Rating (Bonitätsstufe 1 bis 4)								1250%		Durchschau								
		20%	40%	50%	100%	225%	350%	650%	mit Rating	ohne Rating	darunter: Zweitverlustpositionen in ABCP	29								
22	36	23	24	37	25	38	26	27	28	30	34	35	31	32	33					
010	Gesamtsumme																	Übertrag ÜB Meldebogen		
011	darunter: Wiederverbriefungspositionen																	Übertrag ÜB Meldebogen		
020	Originator: Gesamtengagement																			
030	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																			
031	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																			
032	Wiederverbriefungspositionen																			
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																			
071	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																			
072	Wiederverbriefungspositionen																			
080	Vorzeitige Tilgung																			
090	Investor: Gesamtengagement																			
091	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																			
100	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																			
101	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																			
102	Wiederverbriefungspositionen																			
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																			
141	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																			
142	Wiederverbriefungspositionen																			
150	Sponsor: Gesamtengagement																			
160	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																			
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																			

## 18. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA ES

IRBA-Forderungsklasse:

Summenblatt  
(Anlage 3 Nr. 19, 20, 21, 22)

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	Eigenes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage von Kreditrisikominde- rungsstechniken (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominde- rungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA- Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominde- rungsstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionen nach § 99 SolvV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
			Als Gewährleistung berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte		darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen					
					(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge						
	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 + 08	10	11	12
010 1. Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position												
020 Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030 Außenbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitsnachsüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
050 Derivative Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
070 1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind												
080 Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
090 2												
100 3												
110 4												
120 5												
130 6												
140 7												
150 8												
160 9												
170 10												
180 11												
190 12												
200 13												
210 14												
220 15												
230 16												
240 17												
250 18												
260 19												
270 20												

Blatt 1



## 18. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA ES

IRBA-Forderungsklasse:

Summenblatt  
(Anlage 3 Nr. 19, 20, 21, 22)

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen					IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	darunter: Außenbilanzziele Adressenausfallrisikopositionen		
				Als Gewährleistung berücksichtigungs-fähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte						
				Garantien	Kreditderivate		Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge					
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12
280	21												
290	22												
300	23												
310	24												
320	25												
330	26												
340	27												
350	28												
360	29												
370	30												
380	31												
390	32												
400	33												
410	34												
420	35												
430	36												
440	37												
450	38												
460	39												
470	40												
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden											
490	0%												
500	50%												
510	70%												
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
530	90%												
540	115%												
550	250%												
560	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden												
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird												
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen												

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 18. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA ES

IRBA-Forderungsklasse:

Summenblatt  
(Anlage 3 Nr. 19, 20, 21, 22)

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:Ja  
Ort:Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)								Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten											Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	(-) Werberichtungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten											
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	
1010	1. Gesamtsumme												Übertrag üB Meldebogen				
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																	
1020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV																
1030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen																
1040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV																
1050	Derivative Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV																
1060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV																
1070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																	
1080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1																
1090	2																
1100	3																
1110	4																
1120	5																
1130	6																
1140	7																
1150	8																
1160	9																
1170	10																
1180	11																
1190	12																
1200	13																
1210	14																
1220	15																
1230	16																
1240	17																
1250	18																
1260	19																
1270	20																

Blatt 3

18. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA ES

IRBA-Forderungsklasse:

Summenblatt  
(Anlage 3 Nr. 19, 20, 21, 22)

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten					Berücksichtigungsfähige IRBA-Gewährleistungen					(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer	
																Garantien
		Grundpfandrechte IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sachsisicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherungsabtretung von Forderungen												
		13	14	15	16	17	18	19	20					21	22	23
280	21															
290	22															
300	23															
310	24															
320	25															
330	26															
340	27															
350	28															
360	29															
370	30															
380	31															
390	32															
400	33															
410	34															
420	35															
430	36															
440	37															
450	38															
460	39															
470	40															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden																
490	0%															
500	50%															
510	70%															
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren															
530	90%															
540	115%															
550	250%															
560	1.3 Grundpfandrechlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden															
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA- Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

## 18a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA ESA

IRBA-Forderungsklasse:	Summenblatt (Anlage 3 Nr. 19a, 20a, 22a)	Institutsnummer:	Prüfziffer:	Name:
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein	Stand Ende:	Sachbearbeiter/In:	Telefon:
Ort:		in Tsd Euro		

Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen													
IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolV)		IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolV)		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche		Substitutionseffekte		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten		IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	
Internes Ratingssystem		Einem Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete, prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)		darunter: nach der Laufzeitmethode, SM oder IMM berechnet (b)		Garantien		Kreditderivate		Gesamtsumme der Zugänge		Gesamtsumme der Abgänge	
01		02		03		04		05		06		07	
08		09=02+07+08		10		11		12					
1. Gesamtsumme													
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position													
Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV													
Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen													
Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV													
Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV													
Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV													
1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme													
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind													
Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1													
2													
3													
4													
5													
6													
7													
8													
9													
10													
11													
12													
13													
14													
15													
16													
17													
18													
19													
20													

Blatt 1

## 18a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA ESA

IRBA-Forderungsklasse: Summenblatt (Anlage 3 Nr. 19a, 20a, 22a)      Institutsnummer:       Prüfziffer:       Name:

Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Nein

Ort: 

Stand:

Ende: Sachbearbeiter/In: Telefon: 

in Tsd Euro

		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außenbilanzziele Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	darunter: Außenbilanzziele Adressenausfallrisikopositionen				
						Substitutionseffekte	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen	
								(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge
09=02+07+08	10	11	12						
280	21								
290	22								
300	23								
310	24								
320	25								
330	26								
340	27								
350	28								
360	29								
370	30								
380	31								
390	32								
400	33								
410	34								
420	35								
430	36								
440	37								
450	38								
460	39								
470	40								
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme								
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden									
490	0%								
500	50%								
510	70%								
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren								
530	90%								
540	115%								
550	250%								
560	1.3 Grundpfandrehtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden								
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird								
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen								

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 18a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA ESa

IRBA-Forderungsklasse:

Summenblatt (Anlage 3 Nr. 19a, 20a, 22a)

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Nein

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)										Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben	
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige IRBA-Gewährleistungen	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolV)						Anzahl der Kreditnehmer	
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten												
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27		
010	1. Gesamtsumme														Übertrag üB Meldebogen			
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV																	
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																	
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachsüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV																	
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV																	
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV																	
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																	
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1																	
090	2																	
100	3																	
110	4																	
120	5																	
130	6																	
140	7																	
150	8																	
160	9																	
170	10																	
180	11																	
190	12																	
200	13																	
210	14																	
220	15																	
230	16																	
240	17																	
250	18																	
260	19																	
270	20																	

Blatt 3

18a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA ESa

IRBA-Forderungsklasse:

Summenblatt (Anlage 3 Nr. 19a, 20a, 22a)

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Nein

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Eigenkapitalanforderungen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten										Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten										
						Grundpfandrechtl. IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sachsisicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten								
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280	21															
290	22															
300	23															
310	24															
320	25															
330	26															
340	27															
350	28															
360	29															
370	30															
380	31															
390	32															
400	33															
410	34															
420	35															
430	36															
440	37															
450	38															
460	39															
470	40															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden															
490	0%															
500	50%															
510	70%															
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren															
530	90%															
540	115%															
550	250%															
560	1.3 Grundpfandrechtl. besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden															
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

19. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E1

IRBA-Forderungsklasse:		Zentralregierungen		Institutsnummer:		Prüfziffer:		Name:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:		Ja		Ort:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/In:	
								Telefon:	
								in Tsd Euro	

  

	Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
			Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte						
			darunter nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien		Kreditderivate	(-) Gesamtsumme der Zugänge	Gesamtsumme der Zugänge				
	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12
010 1. Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position												
020 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030 Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
050 Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
070 1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind												
080 Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
090 2												
100 3												
110 4												
120 5												
130 6												
140 7												
150 8												
160 9												
170 10												
180 11												
190 12												
200 13												
210 14												
220 15												
230 16												
240 17												
250 18												
260 19												
270 20												



## 19. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E1

IRBA-Forderungsklasse:

Zentralregierungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen					IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	darunter: Außenbilanzziele Adressenausfallrisikopositionen						
				Als Gewährleistung berücksichtigungs-fähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte										
				Kreditderivate	Garantien		Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge									
												01	02	03	04	05	06
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Auswahlwahrscheinlichkeit (%)		darunter: nach der Laufzeitmethode, SM oder IMM berechnet (b)													
280	21																
290	22																
300	23																
310	24																
320	25																
330	26																
340	27																
350	28																
360	29																
370	30																
380	31																
390	32																
400	33																
410	34																
420	35																
430	36																
440	37																
450	38																
460	39																
470	40																
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme																
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden																
490	0%																
500	50%																
510	70%																
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren																
530	90%																
540	115%																
550	250%																
560	1.3 Grundpfandrechtl. besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden																
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird																
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen																

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 19. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E1

IRBA-Forderungsklasse:

Zentralregierungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)										Double Default Effekte	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Eigenkapitalanforderungen Risikogewichteter IRBA-Positionswert (\$ 84 SolvV)	Nachrichtliche Angaben							
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige IRBA-Positionswert (\$ 84 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer (-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeträge (\$ 104 SolvV)													
																		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten		
																						Grundpfandrechte IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27								
010	1. Gesamtsumme															Übertrag üB Meldebogen								
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																						
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV																							
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen																							
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV																							
050	Derivative Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV																							
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV																							
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																							
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																						
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1																							
090	2																							
100	3																							
110	4																							
120	5																							
130	6																							
140	7																							
150	8																							
160	9																							
170	10																							
180	11																							
190	12																							
200	13																							
210	14																							
220	15																							
230	16																							
240	17																							
250	18																							
260	19																							
270	20																							

Blatt 3

# 19. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E1

IRBA-Forderungsklasse:

Zentralregierungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungsstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben								
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungs-fähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten				Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten						(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer							
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungs-fähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten																
						Grundpfandrechliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige Sach-sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten														
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27						
280	21																					
290	22																					
300	23																					
310	24																					
320	25																					
330	26																					
340	27																					
350	28																					
360	29																					
370	30																					
380	31																					
390	32																					
400	33																					
410	34																					
420	35																					
430	36																					
440	37																					
450	38																					
460	39																					
470	40																					
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme																					
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden																					
490	0%																					
500	50%																					
510	70%																					
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren																					
530	90%																					
540	115%																					
550	250%																					
560	1.3 Grundpfandrechlich besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden																					
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird																					
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen																					

## 19a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E1a

IRBA-Forderungsklasse:		Zentralregierungen		Institutsnummer: <input type="text"/>		Prüfziffer: <input type="text"/>		Name: <input type="text"/>	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:		Nein							
Ort: <input type="text"/>		Stand Ende: <input type="text"/>		Sachbearbeiter/in: <input type="text"/>		Telefon: <input type="text"/>		in Tsd Euro	

  

	Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
			Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte						
			Garantien	Kreditderivate		(-) Gesamtsumme der Zugänge	Gesamtsumme der Zugänge					
	Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)		darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet									
	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12
010 1. Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position												
020 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030 Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitenzuschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
050 Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
070 1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind												
080 Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
090 2												
100 3												
110 4												
120 5												
130 6												
140 7												
150 8												
160 9												
170 10												
180 11												
190 12												
200 13												
210 14												
220 15												
230 16												
240 17												
250 18												
260 19												
270 20												

Blatt 1

## 19a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E1a

<b>IRBA-Forderungsklasse:</b>	<b>Zentralregierungen</b>	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Name:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
	Ort:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:
							in Tsd Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen					IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten	IFBA-Positionswert nach § 99 SolV			
				Als Gewährleistung berücksichtigungs-fähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungs-fähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte			darunter: Außerplanzielle Adressenausfallrisikopositionen			
				Garantien	Kreditderivate		(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge					
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)		darunter: nach der Laufzeitmethode, SM oder ILM berechnet						09=02+07+08	10	11	12 darunter: Außerplanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08				
280		21											
290		22											
300		23											
310		24											
320		25											
330		26											
340		27											
350		28											
360		29											
370		30											
380		31											
390		32											
400		33											
410		34											
420		35											
430		36											
440		37											
450		38											
460		39											
470		40											
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden											
490	0%												
500	50%												
510	70%												
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
530	90%												
540	115%												
550	250%												
560	1.3 Grundpfandrehtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden												
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird												
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen												

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 19a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E1a

IRBA-Forderungsklasse:

Zentralregierungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Nein

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)								Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten											Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolV)	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten											
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	
010	1. Gesamtsumme													Übertrag ÜB Meldebogen			
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																	
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV																
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen																
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitsnachsüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV																
050	Derivative Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV																
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV																
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																	
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1																
090	2																
100	3																
110	4																
120	5																
130	6																
140	7																
150	8																
160	9																
170	10																
180	11																
190	12																
200	13																
210	14																
220	15																
230	16																
240	17																
250	18																
260	19																
270	20																

Blatt 3



20. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E2

IRBA-Forderungsklasse:

Institute

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

	IRBA-Forderungsklasse:	Institute	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja	Ort:	Stand Ende:	Sachbearbeiter/in:	Telefon:	in Tsd Euro	IRBA-Positionen											
										Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolV)	darunter: nach der Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnete (b)	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
													Garantien	Kreditderivate		(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge				
										01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme																				
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																				
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV																				
030	Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																				
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitsnachsüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV																				
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV																				
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV																				
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																				
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																				
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1																				
090	2																				
100	3																				
110	4																				
120	5																				
130	6																				
140	7																				
150	8																				
160	9																				
170	10																				
180	11																				
190	12																				
200	13																				
210	14																				
220	15																				
230	16																				
240	17																				
250	18																				
260	19																				
270	20																				

Blatt 1







## 20. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E2

IRBA-Forderungsklasse:

Institute

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)										Double Default Effekte		Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Eigenkapitalanforderungen (\$ 84 SolvV)	Risiko-gewichteter IRBA-Postionswert (\$ 84 SolvV)	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeiträge (\$ 104 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer								
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten														
						Grundpfandrechte IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten												
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27				
280	21																			
290	22																			
300	23																			
310	24																			
320	25																			
330	26																			
340	27																			
350	28																			
360	29																			
370	30																			
380	31																			
390	32																			
400	33																			
410	34																			
420	35																			
430	36																			
440	37																			
450	38																			
460	39																			
470	40																			
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme																			
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden																			
490	0%																			
500	50%																			
510	70%																			
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren																			
530	90%																			
540	115%																			
550	250%																			
560	1.3 Grundpfandrechlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden																			
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird																			
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen																			

## 20a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E2a

IRBA-Forderungsklasse:		Institute		Institutsnummer:		Prüfziffer:		Name:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:		Nein							
Ort:				Stand Ende:		Sachbearbeiter/In:		Telefon:	
in Tsd Euro									

  

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen			
				Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte						
				Garantien	Kreditderivate								
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	darunter nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)				(-) Gesamtsumme der Zugänge	Gesamtsumme der Zugänge	09=02+07+08	10	11	12	
010	1. Gesamtsumme	01	02	03	04	05	06	07	08				
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position													
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030	Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitenzuschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind													
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
090	2												
100	3												
110	4												
120	5												
130	6												
140	7												
150	8												
160	9												
170	10												
180	11												
190	12												
200	13												
210	14												
220	15												
230	16												
240	17												
250	18												
260	19												
270	20												

Blatt 1

## 20a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E2a

IRBA-Forderungsklasse:

Institute

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Nein

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen					IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
				Als Gewährleistung berücksichtigungs-fähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte					
				Garantien	Kreditderivate		(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge				
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)		darunter: nach der Laufzeitmethode, SM oder IMM berechnet (b)					09=02+07+08	10	11	12
280	21											
290	22											
300	23											
310	24											
320	25											
330	26											
340	27											
350	28											
360	29											
370	30											
380	31											
390	32											
400	33											
410	34											
420	35											
430	36											
440	37											
450	38											
460	39											
470	40											
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme											
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden											
490	0%											
500	50%											
510	70%											
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren											
530	90%											
540	115%											
550	250%											
560	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden											
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird											
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen											

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 20a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E2a

IRBA-Forderungsklasse:

Institute

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Nein

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/In:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)										Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen				(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer				
				Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten											
010	1. Gesamtsumme	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27			
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																	
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV																		
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen																		
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitsnachsüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV																		
050	Derivative Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV																		
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV																		
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																		
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																	
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1																		
090	2																		
100	3																		
110	4																		
120	5																		
130	6																		
140	7																		
150	8																		
160	9																		
170	10																		
180	11																		
190	12																		
200	13																		
210	14																		
220	15																		
230	16																		
240	17																		
250	18																		
260	19																		
270	20																		

Blatt 3

## 20a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E2a

IRBA-Forderungsklasse:

Institute

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Nein

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Riskogewichteter IRBA-Positionswert (\$ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben						
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten										Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Riskogewichteter IRBA-Positionswert (\$ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeträge (\$ 104 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten														
						Grundpfandrechte IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige Sachversicherungen IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige Sicherungsabtretung von Forderungen												
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27				
280		21																		
290		22																		
300		23																		
310		24																		
320		25																		
330		26																		
340		27																		
350		28																		
360		29																		
370		30																		
380		31																		
390		32																		
400		33																		
410		34																		
420		35																		
430		36																		
440		37																		
450		38																		
460		39																		
470		40																		
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme																			
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden																			
490	0%																			
500	50%																			
510	70%																			
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren																			
530	90%																			
540	115%																			
550	250%																			
560	1.3 Grundpfandrechte besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden																			
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird																			
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen																			

## 21. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E3

IRBA-Forderungsklasse:		Mengengeschäft		Institutsnummer:		Prüfziffer:		Name:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:		Ja							
Ort:				Stand Ende:		Sachbearbeiter/In:		Telefon:	
in Tsd Euro									

  

	Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
			Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte						
			Garantien	Kreditderivate		(-) Gesamtsumme der Zugänge	Gesamtsumme der Zugänge					
	Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)		darunter nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)									
	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12
010 1. Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position												
020 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030 Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
050 Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
070 1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind												
080 Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
090 2												
100 3												
110 4												
120 5												
130 6												
140 7												
150 8												
160 9												
170 10												
180 11												
190 12												
200 13												
210 14												
220 15												
230 16												
240 17												
250 18												
260 19												
270 20												

Blatt 1



## 21. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E3

IRBA-Forderungsklasse:

Mengengeschäft

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen					IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	darunter: Aufgeblanzte Adressenausfallrisikopositionen	
				Als Gewährleistung berücksichtigungs-fähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte					
				Garantien	Kreditderivate		(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge				
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)		darunter nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)					09=02+07+08	10	11	12
280	21											
290	22											
300	23											
310	24											
320	25											
330	26											
340	27											
350	28											
360	29											
370	30											
380	31											
390	32											
400	33											
410	34											
420	35											
430	36											
440	37											
450	38											
460	39											
470	40											
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme											
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden											
490	0%											
500	50%											
510	70%											
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren											
530	90%											
540	115%											
550	250%											
560	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden											
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird											
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen											

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 21. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E3

IRBA-Forderungsklasse:

Mengengeschäft

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten				Berücksichtigungsfähige Sicherheiten	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben					
													Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Anzahl der Kreditnehmer	
																	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	
																	25	26
13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27				
010	1. Gesamtsumme														Übertrag ÜB Meldebogen			
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																		
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV																	
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																	
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV																	
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV																	
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV																	
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																	
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																		
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1																	
090	2																	
100	3																	
110	4																	
120	5																	
130	6																	
140	7																	
150	8																	
160	9																	
170	10																	
180	11																	
190	12																	
200	13																	
210	14																	
220	15																	
230	16																	
240	17																	
250	18																	
260	19																	
270	20																	

Blatt 3

## 21. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E3

IRBA-Forderungsklasse:

Mengengeschäft

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswenigere Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswenigere durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																															
														Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten			Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten vor Forderungen	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sachschulden	Grundpfandrechte IRBA-Sicherheiten																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																	
13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26					27																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																						
280		21																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																						</

## 22. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E4

IRBA-Forderungsklasse:		Unternehmen		Institutsnummer:		Prüfziffer:		Name:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:		Ja							
Ort:				Stand Ende:		Sachbearbeiter/In:		Telefon:	
in Tsd Euro									

  

	Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
			Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte						
			darunter nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien		Kreditderivate	(-) Gesamtsumme der Zugänge	Gesamtsumme der Zugänge				
	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12
010 1. Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position												
020 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030 Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
050 Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
070 1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind												
080 Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
090 2												
100 3												
110 4												
120 5												
130 6												
140 7												
150 8												
160 9												
170 10												
180 11												
190 12												
200 13												
210 14												
220 15												
230 16												
240 17												
250 18												
260 19												
270 20												

Blatt 1

## 22. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E4

<b>IRBA-Forderungsklasse:</b>	<b>Unternehmen</b>	Institutsnummer:	Prüfziffer:	Name:
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja			
	Ort:	Stand Ende:	Sachbearbeiter/in:	Telefon:

in Tsd Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	darunter: Außerplanzielle Adressenausfallrisikopositionen			
				Als Gewährleistung berücksichtigungs-fähige Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte							
						Garantien	Kreditderivate				(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	
		Einer Ratingsstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)											
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12
280	21												
290	22												
300	23												
310	24												
320	25												
330	26												
340	27												
350	28												
360	29												
370	30												
380	31												
390	32												
400	33												
410	34												
420	35												
430	36												
440	37												
450	38												
460	39												
470	40												
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden												
490	0%												
500	50%												
510	70%												
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
530	90%												
540	115%												
550	250%												
560	1.3 Grundpfandrechlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden												
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird												
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen												

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 22. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E4

IRBA-Forderungsklasse:

Unternehmen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Ja

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)										Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben	
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolV)						Anzahl der Kreditnehmer	
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten												
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27		
010	1. Gesamtsumme															Übertrag üB Meldebogen		
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV																	
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen																	
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV																	
050	Derivative Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV																	
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV																	
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																	
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1																	
090	2																	
100	3																	
110	4																	
120	5																	
130	6																	
140	7																	
150	8																	
160	9																	
170	10																	
180	11																	
190	12																	
200	13																	
210	14																	
220	15																	
230	16																	
240	17																	
250	18																	
260	19																	
270	20																	

Blatt 3



## 22a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E4a

IRBA-Forderungsklasse:		Unternehmen		Institutsnummer:		Prüfziffer:		Name:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:		Nein							
Ort:				Stand Ende:		Sachbearbeiter/In:		Telefon:	
in Tsd Euro									

  

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen			
				Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte						
				Garantien	Kreditderivate								
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	darunter nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)				(-) Gesamtsumme der Zugänge	Gesamtsumme der Zugänge	09=02+07+08	10	11	12	
010	1. Gesamtsumme	01	02	03	04	05	06	07	08				
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position													
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030	Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind													
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
090	2												
100	3												
110	4												
120	5												
130	6												
140	7												
150	8												
160	9												
170	10												
180	11												
190	12												
200	13												
210	14												
220	15												
230	16												
240	17												
250	18												
260	19												
270	20												

Blatt 1



## 22a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E4a

IRBA-Forderungsklasse:

Unternehmen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Nein

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen					IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
				Als Gewährleistung berücksichtigungs-fähige Garantien und Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte					
				Garantien	Kreditderivate		(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge				
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)		darunter: nach der Laufzeitmethode, SM oder IMM berechnet (b)					09=02+07+08	10	11	12
280	21											
290	22											
300	23											
310	24											
320	25											
330	26											
340	27											
350	28											
360	29											
370	30											
380	31											
390	32											
400	33											
410	34											
420	35											
430	36											
440	37											
450	38											
460	39											
470	40											
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme											
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden										
490	0%											
500	50%											
510	70%											
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren											
530	90%											
540	115%											
550	250%											
560	1.3 Grundpfandrehtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden											
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird											
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen											

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 22a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E4a

IRBA-Forderungsklasse:

Unternehmen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Nein

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)								Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (\$ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten											Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen Erwartete Verlustbeiträge (\$ 104 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten											
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	
010	1. Gesamtsumme													Übertrag ÜB Meldebogen			
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position															
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV																
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen																
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV																
050	Derivative Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV																
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV																
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind															
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1																
090	2																
100	3																
110	4																
120	5																
130	6																
140	7																
150	8																
160	9																
170	10																
180	11																
190	12																
200	13																
210	14																
220	15																
230	16																
240	17																
250	18																
260	19																
270	20																

Blatt 3

## 22a. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA E4a

IRBA-Forderungsklasse:

Unternehmen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Eigene Schätzungen von  
Verlustquote bei Ausfall (LGD)  
und/oder IRBA-  
Konversionsfaktoren:

Nein

Ort:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Austral (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen  Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer	
			Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten									
							Grundpfandrechtl IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachanlagen								Berücksichtigungsfähige IRBA- Forderungen
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280		21														
290		22														
300		23														
310		24														
320		25														
330		26														
340		27														
350		28														
360		29														
370		30														
380		31														
390		32														
400		33														
410		34														
420		35														
430		36														
440		37														
450		38														
460		39														
470		40														
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden														
490	0%															
500	50%															
510	70%															
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren															
530	90%															
540	115%															
550	250%															
560	1.3 Grundpfandrechtl. besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden															
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA- Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

### 23. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EN

IRBA-Forderungsklasse:

nachrichtliche Angaben zu einzelnen Unterklassen von IRBA-Forderungsklassen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

99901 Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Name:

Ort:

Stand Ende:

in Tsd Euro

IRBA-Positionswert nach § 99 SolV												
IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten												darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 100 SolV)												darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
Internes Ratingssystem		Substitutionseffekte										
Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstigen Ansprüche										
		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate										
		darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)										
		Garantien										
		Kreditderivate										
		Gesamtsumme der Zugänge										
		(-) Gesamtsumme der Abgänge										
		09=02+07+08										
		10										
		11										
		12										
Forderungsklasse Institute darunter: Kreditinstitute und Wertpapierhandelsunternehmen												
010	Gesamtsumme											
Forderungsklasse Unternehmen darunter: Spezialfinanzierungen												
020	Gesamtsumme											
Forderungsklasse Unternehmen: darunter: Kleine und mittlere Unternehmen												
030	Gesamtsumme											
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Durch Immobilien besichert												
040	Gesamtsumme											
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Qualifiziertes revolvingendes Mengengeschäft												
050	Gesamtsumme											
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Kleine und mittlere Unternehmen												
060	Gesamtsumme											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 1

### 23. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EN

IRBA-Forderungsklasse:	nachrichtliche Angaben zu einzelnen Unterklassen von IRBA-Forderungsklassen		Institutsnummer:		Prüfziffer:	
	99901	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:				
Name:		Ort:		Stand Ende:		

in Tsd Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)			Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen			Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)			Eigenkapitalanforderungen			Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten					Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen													Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten																					
				13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27						
Forderungsklasse Institute darunter: Kreditinstitute und Wertpapierhandelsunternehmen																								
010	Gesamtsumme																							
Forderungsklasse Unternehmen darunter: Spezialfinanzierungen																								
020	Gesamtsumme																							
Forderungsklasse Unternehmen: darunter: Kleine und mittlere Unternehmen																								
030	Gesamtsumme																							
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Durch Immobilien besichert																								
040	Gesamtsumme																							
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Qualifiziertes revolvingendes Mengengeschäft																								
050	Gesamtsumme																							
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Kleine und mittlere Unternehmen																								
060	Gesamtsumme																							

Blatt 2



24. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA-Forderungsklasse:

IRBA EB

Beteiligungen		Institutsnummer:	Prüf- ziffer:	Name:	Ort:	Stand Ende: in Tsd Euro	
	IRBA Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	02					
	Internes Ratingsystem	01					
	Als Gewährleistung berücksichti- garantien und Kreditderivate: Inkongruenzen- bereinigte Beträge	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen	Substitutionseffekte	Garantien	03		
				Kreditderivate	04		
				(-) Gesamtsumme der Abgänge	05		
				Gesamtsumme der Zugänge	06		
	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	07=02 +05+06					
	IRBA-Positions-wert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen	08				
09							
	Risikogewichteter IRBA-Positions-wert nach § 84 SolvV	Positions-wertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	10				
			11				
	Eigenkapitalanforderungen	13					
	Nachrichtlich Angaben	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	14				
			15				
240							
250							
260							
270							
280							
290							
300							
310							
320							
330							
340							
350							
360							
370							
380							
390							
400							
410							
420							
	N						
430	2. Gesamtheit der IRBA-Beteiligungs- positionen, die nach § 98 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht bewertet werden (§ 78 Abs. 2 Nr. 2 SolvV)						
	Aufgliederung dieser IRBA-Beteiligungspositionen nach Risikogewichten						
440	Risikogewicht: 190%						
450	290%						
460	370%						
470	3. Gesamtheit der IRBA-Beteiligungspositionen, die zu einem modelgesteuerten IRBA- Beteiligungsportfolio gehören (§ 78 Abs. 2 Nr. 1b SolvV)						

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit.

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-  
Forderungsklasse:  
Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

in Tsd Euro															
		Gesamtbeitrag der erzeugten Verbriefungspositionen	Synthetische Verbriefung: Auf das verbrieft Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechniken		Verbriefungspositionen	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten auf die IRBA-Bemessungsgrundlage				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	(-) Kreditrisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeibereinge Beträge				
			(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsbereinge Beträge (a)	(-) Abgänge insgesamt		Um Währungsinkongruenzen bereinge berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Nominalbetrag zurückgehaltener oder zurückgeworbener Kreditbesicherung	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 S.4 VV)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Inkongruenzbereinge Beträge			Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzbereinge Beträge	Substitutionseffekte durch Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken auf die IRBA-Bemessungsgrundlage	Zulüsse insgesamt	(-) Abgänge insgesamt
		01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11			
010	Gesamtsumme														
011	darunter: Wiederverbriefungspositionen														
020	Originator: Gesamtengagement														
030	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen														
031	A														
032	B														
033	C														
034	D														
035	E														
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen														
071	A														
072	B														
073	C														
074	D														
075	E														
080	Vorzeitige Tilgung														

(a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche

Blatt 1



25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-  
Forderungsklasse:  
Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Institutsnummer:

	Prüfziffer:	
Ort:		

Name:

Stand Ende:


In Tsd Euro

		Synthetische Verbriefung: Auf das verbrieft Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechniken		Verbriefungs- positionen	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten auf die IRBA-Bemessungsgrundlage				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten		(-) Kreditrisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeibereinigte Beträge	
Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositionen		(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsereinigte Beträge (a)	(-) Abgänge insgesamt		Um Währungsinkongruenzen bereinigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Nominalbetrag zurückbehaltener oder zurückgeworbener Kreditbesicherung	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 Solv)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzereinigte Beträge	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzereinigte Beträge	Substitutionseffekte durch Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken auf die IRBA-Bemessungsgrundlage		
				Zuflüsse insgesamt						(-) Abgänge insgesamt		
		01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11
Investor: Gesamtengagement												
darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist												
Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
A												
B												
C												
D												
E												
Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen												
A												
B												
C												
D												
E												
Sponsor: Gesamtengagement												
Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen												

(a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche

Blatt 2

**IRBA-  
Forderungsklasse:  
Verbriefungsart:**

**25. Meldung über IRBA-Positionen**

<b>Verbriefungen</b>	Institutsnummer:	
<b>Summenblatt</b>	Ort:	

Prüf- ziffer:	Name:
Stand Ende:	

**IRBA EV**

		In Tsd Euro																											
		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungsstechniken	Aufgliederung der IRBA-Bemessungsgrundlage aus Spalte (12) von außerbilanziellen Positionen nach IRBA-Konversionsfaktoren				IRBA-Positionswert (§ 252 SotV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 268 SotV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugspositionen 19=17+18	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten																			
			0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%				Ratingbasierter Ansatz (Bonitätsstufe 1 bis 11 bei Langfristrating)																			
										12	13	14	15	16	17	18	20	21	22	23	24	42	43	44	25	45	46	26	47
010	Gesamtsumme																												
011	darunter: Wiederverbriefungspositionen																												
020	Originator: Gesamtengagement																												
030	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																												
031	A																												
032	B																												
033	C																												
034	D																												
035	E																												
070	Außerbilanzielle und derivative Adressen- ausfallrisikopositionen																												
071	A																												
072	B																												
073	C																												
074	D																												
075	E																												
080	Vorzeitige Tilgung																												

Blatt 3

**IRBA-  
Forderungsklasse:  
Verbriefungsart:**

**25. Meldung über IRBA-Positionen**

Verbriefungen	Institutsnummer:	
Summenblatt	Ort:	

Prüf-  
ziffer:  Name:

Stand Ende:

**IRBA EV**

		in Tsd Euro																													
		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungsstechniken	Aufgliederung der IRBA-Bemessungsgrundlage aus Spalte (12) von außerbilanziellen Positionen nach IRBA-Konversionsfaktoren					IRBA-Positionswert (§ 252 SolV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 268 SolV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugspositionen	19=17+18	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten																			
			0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%	Ratingbasierter Ansatz (Bonitätsstufe 1 bis 11 bei Langfristrating)																								
							7 - 10%					12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	150%	200%	225%	250%	300%	350%	425%	500%	650%	750%	850%					
12	13	14	15	16	17	18	20	21	22	23	24	42	43	44	25	45	46	26	47	27	48	49									
090	<b>Investor: Gesamtengagement</b>																														
091	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																														
100	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																														
101	A																														
102	B																														
103	C																														
104	D																														
105	E																														
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																														
141	A																														
142	B																														
143	C																														
144	D																														
145	E																														
150	<b>Sponsor: Gesamtengagement</b>																														
160	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																														
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																														

Blatt 4

IRBA-Forderungskategorie:

IRBA EV

Verbriefungsart:

Verbriefungen

Summenblatt

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Stand Ende:

Name:

in Tsd Euro														
		Aggregierte Kapitalanforderungen												
		nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen												
		Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen												
		Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Latenzunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen												
		Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 SolV) bei Verstoß gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)												
		Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 SolV)												
		(-) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen												
		1250%		Bankaufsichtlicher Formel Ansatz		Internes Einstufungs- verfahren		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)						
		Ohne Rating	Mit Rating			Durchschau								
						Durchschnittliche Risikogewichtung (%)								

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-  
Forderungsklasse:  
Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Institutsnummer:	
Ort:	

Prüfziffer:	
Stand Ende:	

Name:	
-------	--

in Tsd Euro															
Aggregierte Kapitalanforderungen															
nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen															
Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen															
Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitumdeckung bei synthetischen Verbriefungen															
Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 SolvV) bei Verlust gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)															
Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 SolvV)															
(-) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen															
Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten															
1250%		Bankaufsicht- licher Formel Ansatz		Durchschau		Internes Einstufungs- verfahren									

# 26. Sonderangaben zu den Verbriefungspositionen

E VERSO

in Tsd Euro

Stand Ende:

Ort:

Name

Prüfziffer:

Institutsnummer:

Aggregierte Kapitalanforderungen				29	
Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappingsregelungen				28	
(-) Abzugsbetrag für Verbriefungspositionen				27	
Verbriefungspositionen (Bemessungsgrundlage vor Konversionsfaktoren)	Vorzeitige Tilgungsmöglichkeit	Angewandter Konversionsfaktor		26	
		Kontrolliert? (ja/nein)		25	
	Außerbilanzielle Positionen und Derivate	Sonstige		24	
		Qualifizierte Verbriefungs-Liquiditätsfazilität		23	
		Direktes Kreditsubstitut		22	
	Bilanzpositionen	Erstverlustposition	ohne Rating	21	
			Rating	20	
		Mezzanine	ohne Rating	19	
			Rating	18	
		Höchst-rangig	ohne Rating	17	
			Rating	16	
	Verbriefungsstruktur	Erstverlustposition			
Verbriefte Positionen	Eigenkapitalanforderungen vor Verbriefung %			14	
	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen			13	
	ELGD %			12	
	Anzahl der Positionen			11	
	Verwendeter Ansatz (SA/IRB/MIX)			10	
	Art			09	
	Anteil des Instituts (%)			08	
Gesamtbetrag				07	
Verbriefungen ohne ABCP-Programme	Gesamtbetrag der verbrieften Positionen zu Beginn der Verbriefung			06	
	Datum der Verbriefung (MM/JJJJ)			05	
Stellung des Instituts: (SPONSOR / ORIGINATOR/ URSPRÜNGLICHER KREDITGEBER)				04	
Selbstbehalt (§ 18a Abs. 1 KWG)	Einhaltung der Anforderung an den Selbstbehalt			33	
	%Anteil des Selbstbehalts zum Meldestichtag			31	
	Art des Selbstbehalts			30	
Verbriefung/ Wiederverbriefung				32	
Verbriefungsart (Synthetisch / Traditionell)				03	
Kennung der Verbriefung				02	
Interner Code				01	

# 27. Meldung über Abwicklungsrisikopositionen

E ABW

Instituts- nummer	
Name:	

Prüfziffer:	
Ort:	

Stand Ende:	
-------------	--

		in Tsd Euro		
	Geschäftstage nach vereinbartem Abrechnungstermin	Vereinbarter Abrechnungspreis	Zugunsten des Institutes bestehender Unterschiedsbetrag	Eigenkapitalanforderung (§ 16 SolvV)
		01	02	03
<b>010</b>	Gesamtsumme			
<b>011</b>	Gesamtsumme Anlagebuch			Übertrag ÜB-Meldebogen
020	0 bis 4			
030	5 bis 15			
040	16 bis 30			
050	31 bis 45			
060	mehr als 45			
<b>070</b>	Gesamtsumme Handelsbuch			Übertrag ÜB-Meldebogen
080	0 bis 4			
090	5 bis 15			
100	16 bis 30			
110	31 bis 45			
120	mehr als 45			

## 28. Meldung zum operationellen Risiko

E OPR

Institutsnummer:  Prü fziffer:  Name:

Ort:  Stand Ende:

99901	Angabe des Geschäftsjahres, auf das sich die Spalten 3 und 6 beziehen	
-------	---	--

in Tsd Euro

Nachrichtlich Angaben (bei Verwendung fortgeschrittener Messansätze)														
Höhe des Überschreibungsbetrages der in § 292 Abs. 1 Satz 2 SolvV festgelegten Höchstgrenze bei der Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlagerung														
darunter: Berücksichtigung von Versicherungen (§292 SolvV)														
(-) Reduzierung der Eigenkapitalanforderungen aufgrund der Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlagerung (§ 292 SolvV)														
(-) Reduzierung der Eigenkapitalanforderungen aufgrund der angemessenen Berücksichtigung der erwarteten Verluste in den internen Geschäftspraktiken (§ 284 Abs. 2 SolvV)														
Eigenkapitalanforderungen vor Berücksichtigung von Reduktionseffekten aufgrund angemessener Berücksichtigung des erwarteten Verlustes in den internen Geschäftspraktiken und vor Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlagerung (§292 SolvV)														
darunter: Aufgrund gruppeninterner Allokationsmechanismen zugeordnete Eigenkapitalanforderungen (§278 Abs. 4 SolvV)														
Eigenkapitalanforderungen (§§ 270, 273, 274 und 278 SolvV)														
Nominales Kreditvolumen (nur erforderlich bei Verwendung eines alternativen Indikators) nach § 274 (3) SolvV														
Relevanter Indikator (Bruttoertrag) nach § 271 SolvV														
Geschäftsfelder														
01														
02														
03														
04														
05														
06														
07														
08														
09 = 07-10-11														
10														
11														
12														
13														
010	1. Basisindikatoransatz (BIA)							Übertrag ÜB-Meldbogen						
020	2. Gesamtheit der unter den Standardansatz (STA) / Alternativen Standardansatz (ASA) fallenden Geschäftstätigkeiten							Übertrag ÜB-Meldbogen						
	<u>Zuordnung der Geschäftstätigkeiten im Standardansatz nach Geschäftsfeld:</u>													
030	Unternehmensfinanzierung, -beratung													
040	Handel													
050	Wertpapierprovisionsgeschäft													
060	Firmenkundengeschäft													
070	Privatkundengeschäft													
080	Zahlungsverkehr und Abwicklung													
090	Depot- und Treuhandgeschäft													
100	Vermögensverwaltung													
	<u>Zuordnung der Geschäftstätigkeiten im Alternativen Standardansatz nach Geschäftsfeld:</u>													
110	Firmenkundengeschäft													
120	Privatkundengeschäft													
130	3. Fortgeschrittene Messansätze (AMA) a)							Übertrag ÜB-Meldbogen						

a) Informationen zum relevanten Indikator sind nur im Falle einer Kombination eines fortgeschrittenen Messansatzes mit dem Basisindikator- bzw. Standardansatz erforderlich



Institutsnr.:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

	Potenziieller Risikobetrag	Potenziieller Risikobetrag	Potenziieller Krisen-Risikobetrag	Anrechnungsbetrag für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko	In Ted Euro
	Gewichtungsfaktor x Durchschnitt der potenziellen Risikobeträge der letzten 60 Geschäftstage	Potenziieller Risikobetrag vom Vortag	Gewichtungsfaktor x Durchschnitt der potenziellen Risikobeträge der letzten 60 Geschäftstage	Zweifwöchiger Durchschnitt der nach §§ 318a bis 318d SolW ermittelten Beträge für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko	Nach §§ 318a bis 318d SolW zuletzt ermittelter Betrag für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko
010 Positionen	01	02	08	10	11
Nachrichtlich: gegliedert nach Markisiko-Kategorien					
020 1 Zinsrisikoposition					
030 1.1 Allgemeines Kursrisiko					
040 1.2 Besonderes Kursrisiko					
050 2 Aktienrisikoposition					
060 2.1 Allgemeines Kursrisiko					
070 2.2 Besonderes Kursrisiko					
080 3 Währungs-gesamposition					
090 4 Rohwarenposition					
100 5 Gesamtbetrag für das allgemeine Kursrisiko					
110 6 Gesamtbetrag für das besondere Kursrisiko					

Seite 1

29. Meldung über Marktrisikopositionen Verwendung eigener Risikomodelle

Institute-  
nummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

	Anrechnungsbeträge für das Correlation Trading Portfolio					Nachrichtlich:				in Tsd Euro	
	Mindestanrechnungsbetrag für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 4 SolV)	Zwölfwöchiger Durchschnitt der nach § 318e SolV zuletzt ermittelten Beträge für das Correlation Trading Portfolio	Nach § 318e SolV zuletzt ermittelter Betrag für das Correlation Trading Portfolio	Zusätzliche Eigenkapitalanforderung für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 3)	Eigenmittelanforderung	Anzahl der Ausnahmen in den letzten 250 Geschäftstagen	Gewichtungsfaktor nach § 314 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 Buchstabe b SolV	Gewichtungsfaktor nach § 314 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 Buchstabe b SolV	Summe der Berücksichtigungsbeträge für aktivisch ausgerichtete Zinsnettopositionen des Correlation Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 1 SolV)	Summe der Berücksichtigungsbeträge für passivisch ausgerichtete Zinsnettopositionen des Correlation Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 2 SolV)	
010	12 = 8% * Max [18, 19]	13	14	15	05=Max (01,02) + Max (08,09) + Max (10,11) + Max [12,13,14] + 15 Übertrag UB-Meldebogen	06	16	17	18	19	
020	Nachrichtlich: begleitet nach Markisiko-Kategorien										
030	1.1 Allgemeines Kursrisiko										
040	1.2 Besonderes Kursrisiko										
050	2 Aktiennettoposition										
060	2.1 Allgemeines Kursrisiko										
070	2.2 Besonderes Kursrisiko										
080	3 Währungs-gesamtposition										
090	4 Rohwarenposition										
100	5 Gesamtbetrag für das allgemeine Kursrisiko										
110	6 Gesamtbetrag für das besondere Kursrisiko										

Seite 2

30. Marktrisikomeldung Währungsgesamtposition

MKR FW

Institutsnummer: \_\_\_\_\_

Prüfziffer: \_\_\_\_\_

Name: \_\_\_\_\_

Stand Ende: \_\_\_\_\_

Ort: \_\_\_\_\_

- in Tsd Euro -

Positionen	Insgesamt (Spalte 02 bis 07)	USD 02	GBP 03	CHF 04	JPY 05	CAD 06	Übrige Fremdwährungen 07	Gold 08
<b>Aktivpositionen</b>								
1 Bilanzelle Vermögensgegenstände einschl. zeitan­teiler Erträge	010							
2 Liefer- und Zahlungsansprüche aus Kassageschäften	020							
sonstigen Derivaten ohne Optionsrechte der Positionen 3 und 4	030							
Ansprüche auf Zahlung von Kapitalbeträgen aus Finanz-Swaps	040							
3. Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zuzustehende Liefer- oder Zahlungsansprüche aus Devisen- oder Goldoptionen	050							
4. Sonstige eigene Optionsrechte	060							
5. Sonstige Aktivpositionen	070							
<b>Aktivpositionen insgesamt</b>	100							
<b>Passivpositionen</b>								
1. Bilanzelle Schulden einschließlich zeitan­teiler Aufwendungen	110							
2. Liefer- und Zahlungsverpflichtungen aus Kassageschäften	120							
sonstigen Derivaten ohne Optionsrechte der Positionen 3 und 4	130							
Verpflichtungen zur Zahlung von Kapitalbeträgen aus Finanz-Swaps	140							
3. Als Optionsberechtigter/Stillhalter zu erfüllende Liefer- oder Zahlungsverpfl. aus Devisen- oder Goldoptionen	150							
4. Sonstige fremde Optionsrechte	160							
5. Sonstige Passivpositionen	170							
<b>Passivpositionen insgesamt</b>	200							
<b>Offene Einzelwährungsposition</b>	210	+	+	+	+	+	+	+
	220	-	-	-	-	-	-	-
<b>Nettowährungsposition</b>	230							
(der größere Betrag - ohne Vorzeichen - der Zeilen 210/01 oder 220/01)								
abzüglich 50 % der aus gegliederten Währungsposition in eng verbundenen Währungen	240	-						
<b>zuzüglich offene Goldposition</b>	250	+						
(Betrag der Zeile 230 /08)								
<b>zuzüglich des Anrechnungsbetrages für Investimentanteile nach § 294 Abs. 6 Satz 6 SolvV</b>	255	+						
(Betrag der Zeile 230 /08)								
<b>Nettoabgrenzungsbetrag für zeitl. Erträge/Aufwendungen</b>	260	+						
(nur für Institute, bei denen die Abgrenzung nicht pro Fremdwährung verfügbar ist)								
<b>Währungsgesamtposition</b>	270							
(Summe der Zeilen 230 bis 260)								

99001

x 8,0 %

Anrechnungsbetrag für Währungsgesamtposition

Nachrichtlich:

Strukturelle Währungspositionen nach § 4 Abs. 4 SolvV

Abzugsposten in Fremdwährung nach § 4 Abs. 4 SolvV

99002

99003

### 31. Marktrisikomeldung Rohwarenposition

MKR RW

Stand Ende:

Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüzfiffer \_\_\_\_\_ Name: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_

- in Tsd Euro -

Positionen		Insgesamt	Öle, Petroleum und Gas	Landwirtschaftl. Erzeugnisse	Metalle	Übrige Rohwaren
		01	02	03	04	05
<b>Aktivpositionen</b>						
1. Unter Aktiva der Bilanz auszuweisende Rohwarenbestände	010					
2. Lieferansprüche aus						
Kassageschäften	020					
Termingeschäften	030					
Swapgeschäften	040					
3. Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zustehende Lieferansprüche	050					
4. Eventualansprüche auf Rückgabe von in Pension gegebenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	060					
<b>Aktivpositionen insgesamt</b>	100					
<b>Passivpositionen</b>						
1. Lieferverpflichtungen aus						
Kassageschäften	110					
Termingeschäften	120					
Swapgeschäften	130					
2. Als Optionsberechtigter/Stillhalter zu erfüllende Lieferverpflichtungen	140					
3. Eventualverbindlichkeiten auf Rückgabe von in Pension genommenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	150					
<b>Passivpositionen insgesamt</b>	200					

#### I. Vereinfachtes Verfahren

		01	02	03
Summe der Aktiv- und Passivpositionen	210		x 3,0 %	
Summe der offenen Rohwareneinzelpositionen	220		x 15,0 %	
	230	<b>Summe A</b>		

#### II. Zeitfächermethode

		01	02	03
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen nach § 297 Abs. 2 Satz 3 SolvV	300		x 0 %	
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen vor und nach der Verrechnung zwischen den Zeitfächern	310		x 3,0 %	
Summe der offenen Bereichspositionen nach Verrechnung	320		x 0,6 %	
Verbleibende offene Bereichsposition	330		x 15,0 %	
	340	<b>Summe B</b>		
	350	<b>Anrechnungsbetrag für Rohwarenposition (Zeile 230+340)</b>		

### 32. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition

MKR ZK

Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüfziffer: \_\_\_\_\_ Name: \_\_\_\_\_ Stand Ende: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_ Blatt 1

Allgemeines Kursrisiko Zinsnettoposition									
		Insgesamt (Summe aus Spalten 02 bis 16)	Kurzfristige Laufzeitzone				Mittelfristige Laufzeitzone		
		01	02	03	04	05	06	07	08
Nominalverzinsung < 3 % bzw. gemäß Duration			bis zu einem Monat	über einem bis zu drei Monaten	über drei bis zu sechs Monaten	über sechs Monaten bis zu einem Jahr	über einem bis zu 1,9 Jahren	über 1,9 bis zu 2,8 Jahren	über 2,8 bis zu 3,6 Jahren
Nominalverzinsung ≥ 3 %			bis zu einem Monat	über einem bis zu drei Monaten	über drei bis zu sechs Monaten	über sechs Monaten bis zu einem Jahr	über einem bis zu 2 Jahren	über 2 bis zu 3 Jahren	über 3 bis zu 4 Jahren
		110							
I. Jahresbandmethode		aktivische Ausrichtung							
Zinsnettoposition		passivische Ausrichtung							
Insgesamt		120							
darunter:		aktivische Ausrichtung							
in Euro		passivische Ausrichtung							
140									
darunter:		aktivische Ausrichtung							
in US-\$		passivische Ausrichtung							
160									
II. Durationmethode:		aktivische Ausrichtung							
Zinsnettoposition		passivische Ausrichtung							
180									
gewichtete Zinsnettoposition		aktivische Ausrichtung							
190									
Insgesamt		passivische Ausrichtung							
200									
darunter:		aktivische Ausrichtung							
gewichtete		passivische Ausrichtung							
210									
Zinsnettoposition		aktivische Ausrichtung							
in Euro		passivische Ausrichtung							
220									
darunter:		aktivische Ausrichtung							
gewichtete		passivische Ausrichtung							
Zinsnettoposition		aktivische Ausrichtung							
in US-\$		passivische Ausrichtung							
240									
Teilrechnungsbetrag für das allgemeine Kursrisiko		300							

## 32. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition

MKR ZK

Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüzfiffer: \_\_\_\_\_ Name: \_\_\_\_\_ Stand Ende: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_ Blatt 2

### Allgemeines Kursrisiko Zinsnettoposition

- in Tsd Euro -

		Langfristige Laufzeitzone							
Nominalverzinsung < 3 % bzw. gemäß Duration		über 3,6 bis zu 4,3 Jahren	über 4,3 bis zu 5,7 Jahren	über 5,7 bis zu 7,3 Jahren	über 7,3 bis zu 9,3 Jahren	über 9,3 bis zu 10,6 Jahren	über 10,6 bis zu 12,0 Jahren	über 12,0 bis zu 20,0 Jahren	über 20,0 Jahren
Nominalverzinsung ≥ 3 %		über 4 bis zu 5 Jahren	über 5 bis zu 7 Jahren	über 7 bis zu 10 Jahren	über 10 bis zu 15 Jahren	über 15 bis zu 20 Jahren	über 20 Jahren		
		09	10	11	12	13	14	15	16
I. Jahresbandmethode Zinsnettoposition Insgesamt	aktivische Ausrichtung	110							
	passivische Ausrichtung	120							
	aktivische Ausrichtung	130							
	passivische Ausrichtung	140							
		150							
darunter: in US-\$	passivische Ausrichtung	160							
	aktivische Ausrichtung	170							
II. Durationsmethode: Zinsnettoposition Insgesamt	passivische Ausrichtung	180							
	aktivische Ausrichtung	190							
	passivische Ausrichtung	200							
	aktivische Ausrichtung	210							
		220							
darunter: gewichtete Zinsnettoposition in Euro	aktivische Ausrichtung	230							
	passivische Ausrichtung	240							

32. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition

MKR ZK

Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüfziffer: \_\_\_\_\_ Name: \_\_\_\_\_ Stand Ende: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_ Blatt 3

Besonderes Kursrisiko Zinsnettoposition

- in Tsd Euro -

Positionen	Zinsnettoposition		Gewichtungssätze	risikogewichtete Zinsnettoposition	Gewichtung nach § 303 Abs. 1	Anrechnungsbeträge	
	01	02				03	05
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 2 und Abs. 2a	310	x 0,0 %					
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 3	320	x 3,125 %			X 8 %		
Restlaufzeit bis 6 Monate	330	x 12,5 %					
Restlaufzeit über 6 Monate bis zu 2 Jahren	340	x 20,0 %					
Restlaufzeit von mehr als 2 Jahren	350	x 100,0 %					
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 1	360	x 150,0 %					
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 4	380						
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 6	400						
Summe Zinsnettopositionen					Teilanrechnungsbetrag für das besondere Kursrisiko		

Pauschalierter Anrechnungsbetrag für Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 1 und 2 SolvV

Positionen	Maßgeblicher Betrag		Gewichtungssätze	Anrechnungsbeträge
	01	02		
Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 1	500	X 32%		
Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 2	510	X 40 %		
Summe	520			

### 33. Marktrisikomeldung Aktiennettoposition

MKR AK

Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüzfiffer: \_\_\_\_\_ Name: \_\_\_\_\_ Stand Ende: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_

Nationaler Markt des Emittenten	Aktiennettoeinzelpositionen		Aktiennettoposition (saldierte Nettoposition)	Anrechnungsbeträge für das allgemeine Kursrisiko Spalte 03 x 8,0 %		Aktienbruttoposition	Anrechnungsbeträge für das besondere Kursrisiko Spalte 08 x 8,0%	
	aktivische Ausrichtung 01	passivische Ausrichtung 02		03	04		08	09
Deutschland 010								
Frankreich 020								
Großbritannien 030								
Japan 040								
USA 050								
übrige Länder 060								
070	Teilanzrechnungsbetrag für das allgemeine Kursrisiko (Summe der Spalte 04)			A		Summe		
080				Teilanzrechnungsbetrag für das besondere Kursrisiko (Summe der Spalte 09)		B		
090				Anrechnungsbetrag für Aktiennettoposition (A+B)		C		



**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB =(3))	Telefon:	

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0010	1	Anrechenbare Eigenmittel insgesamt		=1.1+1.2+1.3+1.6+1.7 =1.4+1.5+1.6
0020	1.1	Kernkapital		anrechenbares Kernkapital 1.1.1+1.1.2+1.1.3+1.1.4+1.1.5
0030	1.1.1	Eingezahltes Kapital		1.1.1.1+1.1.1.2+1.1.1.3+1.1.1.4
0051	1.1.1***	darunter (nachrichtlich): Kernkapitalinstrumente, die Aktien gleichgestellt sind		
0052	1.1.1****	darunter (nachrichtlich): Kernkapitalinstrumente, welche nicht- kumulative Vorzugsrechte auf Dividendenzahlungen beinhalten		
0060	1.1.1.1	Eingezahltes Kapital (Geschäfts-, Grund-, Stamm-, Dotationskapital und Geschäftsguthaben) ohne kumulative Vorzugsaktien		Hier zu erfassen sind: Eingezahltes Kapital (Geschäfts-, Grund-, Stamm-, Dotationskapital und Geschäftsguthaben) ohne kumulative Vorzugsaktien; von der BaFin anerkanntes freies Vermögen. Der Ausweis erfolgt unter Abzug der auf die gruppenangehörigen Unternehmen entfallenden Buchwerte der Kapitalanteile (ohne kumulative Vorzugsaktien).
0070	1.1.1.2	(-) Eigene Anteile oder Geschäftsanteile (ohne eigene kumulative Vorzugsaktien) sowie gekündigte Geschäftsguthaben und Geschäftsguthaben ausscheidender Genossen		siehe auch § 10 Abs. 2a Satz 1 Nr. 2 und 3 KWG
0080	1.1.1.3	Kapitalrücklage (Emissionsagiokonto)		Der Ausweis erfolgt unter Abzug der auf die gruppenangehörigen Unternehmen entfallenden Rücklagen.
0091	1.1.1.4	Anderes Kapital gemäß § 10 Abs. 2a Satz 1 Nr. 8 KWG		Der Ausweis erfolgt unter Abzug der auf die gruppenangehörigen Unternehmen entfallenden Kapitalinstrumente im Sinne von § 10 Abs. 2a Satz 1 Nr. 8 KWG. Instrumente, welche die Anforderungen nach § 10 Abs. 2a Satz 1 Nr. 8 KWG nicht erfüllen und daher unter die Übergangsvorschrift nach § 64m Abs. 1 KWG fallen, sind unter 1.1.4.1a.04 oder 1.1.4.1a.05 auszuweisen.
0100	1.1.2	Sonstige anrechenbare Rücklagen		1.1.2.1+1.1.2.2+1.1.2.3+1.1.2.4a +1.1.2.4.b + 1.1.2.5+1.1.2.6
0110	1.1.2.1	Sonstige Rücklagen		= 1.1.2.1.01 + 1.1.2.1.02  sonstige Rücklagen (ohne in Pos. 1.1.1.3 ausgewiesene Kapitalrücklage). Der Ausweis erfolgt unter Abzug der auf die gruppenangehörigen Unternehmen entfallenden Rücklagen. Der Ausweis erfolgt hier unter Berücksichtigung des Bilanzgewinns nach § 10 Abs. 2a Satz 1 Nr. 9 KWG bzw. unter Berücksichtigung des Bilanzverlustes nach § 10 Abs. 2a Satz 2 Nr. 1 KWG.
0111	1.1.2.1.01	Sonstige Rücklagen		Auszuweisen sind hier die im Geschäftsabschluss ausgewiesenen Sonstigen Rücklagen nach § 10 Abs. 2a Satz 1 KWG

Blatt 1

**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB = (3))		Telefon:

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0112	1.1.2.1.02	<i>Bereinigung um einen auf die Sonstigen Rücklagen entfallenden Anteil, der auf im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften beruht</i>		
0120	1.1.2.2	<i>Anteile in Fremdbesitz (minority interest)</i>		=1.1.2.2.01+1.1.2.2.02+1.1.2.2.03
0141	1.1.2.2***01	darunter (nachrichtlich): Sonstiges Kapital, wandelbar in einer Belastungssituation		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 5 KWG
0142	1.1.2.2***02	darunter (nachrichtlich): Sonstiges Kapital, unbefristet und ohne Tilgungsanreize		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 4 KWG
0143	1.1.2.2***03	darunter (nachrichtlich): Sonstiges Kapital, befristet oder mit Tilgungsanreizen		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 3 KWG
0144	1.1.2.2***04	darunter (nachrichtlich): Begrenzt anrechenbare, einer Übergangsvorschrift unterliegende Kernkapitalinstrumente, unbefristet und ohne Tilgungsanreize		indirekt emittierte Instrumente ohne Tilgungsanreize, die nicht den Anforderungen des § 10 Abs. 4 KWG entsprechen und dennoch gemäß § 64m Abs. 1 KWG als Kernkapitalinstrumente angerechnet werden dürfen
0145	1.1.2.2***05	darunter (nachrichtlich): Begrenzt anrechenbare, einer Übergangsvorschrift unterliegende Kernkapitalinstrumente, befristet oder mit Tilgungsanreizen		indirekt emittierte Instrumente mit Tilgungsanreizen, die nicht den Anforderungen des § 10 Abs. 4 KWG entsprechen und dennoch gemäß § 64m Abs. 1 KWG als Kernkapitalinstrumente angerechnet werden dürfen
0146	1.1.2.2.01	Anteile in Fremdbesitz		
0147	1.1.2.2.02	Bereinigung um einen auf die Anteile in Fremdbesitz entfallenden Anteil, der auf im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften beruht		
0148	1.1.2.2.03	(-) Bestand an Anteilen in Fremdbesitz, welche nicht als Kernkapital berücksichtigungsfähig sind		
0150	1.1.2.3	<i>Zwischengewinn / Zwischenverlust (aufsichtlich)</i>		= 1.1.2.3.01+1.1.2.3.02.
0160	1.1.2.3.01	Zwischengewinn des laufenden Geschäftsjahres		Auszuweisen ist hier der im Zwischenabschluss nach § 10a Abs. 10 KWG auf Konzernebene bzw. auf aggregierter Ebene ausgewiesene Gewinn
0170	1.1.2.3.02	Bereinigung um einen auf diesen Zwischengewinn entfallenden Anteil, der auf im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften beruht		Der hier auszuweisende Betrag betrifft die Bewertungseffekte in Pos. 1.1.2.6.07, 1.2.6.11. und 1.1.2.6.13, deren Auswirkungen auf das Kernkapital über Pos. 1.1.2.6 berücksichtigt werden.

Blatt 2

**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB = (3))	Telefon:	

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
			01	02
0180	1.1.2.4a	<b>(-) Wesentliche Verluste des laufenden Geschäftsjahres, Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 3b KWG</b>		
0190	1.1.2.4a.01	Wesentliche Verluste des laufenden Geschäftsjahres, Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 3b KWG		da tendenziell Nettoausweis in Zeile 180 erfolgt, können Zeilen 190 und 200 auch b.a.w. entfallen
0200	1.1.2.4a.02	Bereinigung um einen auf diesen Verlust entfallenden Anteil, der auf im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften beruht		da tendenziell Nettoausweis in Zeile 180 erfolgt, können Zeilen 190 und 200 auch b.a.w. entfallen
0210	1.1.2.4b	<b>Zwischengewinn / Zwischenverlust (aufsichtlich)</b>		= 1.1.2.4b.01+1.1.2.4b.02
0220	1.1.2.4b.01	(-) Zwischenverlust des laufenden Geschäftsjahres		Auszuweisen ist hier der im Zwischenabschluss nach § 10a Abs. 10 KWG auf Konzernebene bzw. auf aggregierter Ebene ausgewiesene Verlust
0230	1.1.2.4b.02	Bereinigung um einen auf diesen Zwischenverlust entfallenden Anteil, der auf im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften beruht		Der hier auszuweisende Betrag betrifft die Bewertungseffekte in Pos. 1.1.2.6.07, 1.1.2.6.11. und 1.1.2.6.13, deren Auswirkungen im Kernkapital sich in Pos. 1.1.2.6 niederschlagen
0240	1.1.2.5	<b>(-) Nettogewinne aus der Kapitalisierung künftiger Erträge verbriefter Forderungen</b>		§ 10 Abs. 3a Satz 4 KWG: Bei einem Institut, das Originator einer Verbriefungstransaktion ist, gelten die Nettogewinne aus der Kapitalisierung der künftigen Erträge der verbrieften Forderungen, die die Bonität von Verbriefungspositionen verbessern, nicht als Rücklagen im Sinne von Absatz 2a Satz 1
0250	1.1.2.6	<b>Im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften (Prudential Filters)</b>		1.1.2.6.01 bis 1.1.2.6.14
0260	1.1.2.6.01	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten		Ausweis erfolgt hier unter Berücksichtigung von Cash-Flow-Hedging nach § 5 Abs. 2 KonÜV
0270	1.1.2.6.02	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten		(§ 2 Abs.1 KonÜV i.V.m. § 5 Abs. 2 KonÜV)
0280	1.1.2.6.03	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Krediten und sonstigen Forderungen		
0290	1.1.2.6.04	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Krediten und sonstigen Forderungen		(§ 2 Abs. 3 KonÜV)
0300	1.1.2.6.05	Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögenswerten		Ausweis erfolgt hier unter Berücksichtigung von Cash-Flow-Hedging nach § 5 Abs. 2 KonÜV
0310	1.1.2.6.06	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögenswerten		(§ 2 Abs.1 KonÜV i.V.m. § 5 Abs. 2 KonÜV)

Blatt 3

**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB = (3))	Telefon:	

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
			01	02
0320	1.1.2.6.07	Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf finanzielle Verbindlichkeiten (eigenes Kreditrisiko)		
0330	1.1.2.6.08	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf finanzielle Verbindlichkeiten (eigenes Kreditrisiko)		(§ 6 KonÜV)
0340	1.1.2.6.09	Bewertungseffekte aus Cash Flow Hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögenswerten dienen		
0350	1.1.2.6.10	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögenswerten dienen		(§ 5 Abs. 1 KonÜV)
0360	1.1.2.6.11	Bewertungseffekte aus als Finanzinvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden		
0370	1.1.2.6.12	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden		(§ 3 KonÜV)
0380	1.1.2.6.13	Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden		
0390	1.1.2.6.14	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden		(§ 3 KonÜV)
0400	1.1.2.6.15	Andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen		
0410	1.1.2.6.16	Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen		
0420	1.1.3	<b>Sonderposten für allgemeine Bankrisiken nach § 340g HGB</b>		
0430	1.1.4	<b>Andere und landesspezifische Kernkapitalbestandteile</b>		=1.1.4.1a+1.1.4.3+1.1.4.4
0451	1.1.4.1a	<b>Sonstiges Kapital</b>		=1.1.4.1a.01+1.1.4.1a.02+1.1.4.1a.03+1.1.4.1a.04+1.1.4.1a.05  Diese Position enthält nicht nur direkt emittierte, dem Sonstigen Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 3 bis 5 KWG zugeordnete Instrumente, sondern auch solche indirekt emittierten, dem Sonstigen Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 3 bis 5 KWG zugeordnete Instrumente, die jedoch nicht der Position 0120/01 zugerechnet werden, da es sich hier aus Sicht der Rechnungslegung um Verbindlichkeiten handelt.
0452	1.1.4.1a.01	Sonstiges Kapital, wandelbar in einer Belastungssituation		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 5 KWG

Blatt 4

### 34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB =(3))		Telefon:

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
			(a) 01	02
0453	1.1.4.1a.02	Sonstiges Kapital, unbefristet und ohne Tilgungsanreize		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 4 KWG
0454	1.1.4.1a.03	Sonstiges Kapital, befristet oder mit Tilgungsanreizen		siehe auch: Zelle 1.1.5.2a Sonstiges Kapital nach § 10 Abs. 2 Satz 3 KWG
0455	1.1.4.1a.04	Begrenzt anrechenbare, einer Übergangsvorschrift unterliegende Kernkapitalinstrumente, unbefristet und ohne Tilgungsanreize		Direkt emittierte Instrumente ohne Tilgungsanreize, die nicht den Anforderungen des § 10 Abs. 4 KWG entsprechen und dennoch gemäß § 64m Abs. 1 KWG als Kernkapitalinstrumente angerechnet werden dürfen.
0456	1.1.4.1a.05	Begrenzt anrechenbare, einer Übergangsvorschrift unterliegende Kernkapitalinstrumente, befristet oder mit Tilgungsanreizen		Direkt emittierte Instrumente mit Tilgungsanreizen, die nicht den Anforderungen des § 10 Abs. 4 KWG entsprechen und dennoch gemäß § 64m Abs. 1 KWG als Kernkapitalinstrumente angerechnet werden dürfen.
0460	1.1.4.3	<b>Korrekturposten (positiv) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften</b>		
0470	1.1.4.4	<b>Gesamtbetrag des aktivischen Unterschiedsbetrages gemäß § 10 a Abs. 6 Satz 9 und 10 KWG abzüglich mindestens 50% des Teilbetrages, der nicht wie eine Beteiligung an einem gruppenfremden Unternehmen behandelt wird</b>		
0480	1.1.5	<b>(-) Sonstige Abzugspositionen vom Kernkapital</b>		=1.1.5.1+1.1.5.2a+1.1.5.3a+1.1.5.4
0490	1.1.5.1	<b>(-) Immaterielle Vermögensgegenstände</b>		
0511	1.1.5.2a	<b>(-) Abzugspositionen aus Überschreitung der Anrechnungsgrenzen des Sonstigen Kapitals</b>		=1.1.5.2a.01+1.1.5.2a.02+1.1.5.2a.03+1.1.5.2a.04  Die Beträge aus der Überschreitung der Anrechnungsgrenzen gemäß § 10 Abs. 2 Satz 3 bis 5 sowie gemäß § 64m Abs. 1 und 2 KWG der in den Positionen 0141/01 bis 0145/01 sowie 0451/01 gemeldeten Kapitalbestandteile sind hier abzuziehen.
0512	1.1.5.2a.01	(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze nach § 10 Abs. 2 Satz 5 KWG		§ 10 Abs. 2 Satz 5 KWG
0513	1.1.5.2a.02	(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze nach § 10 Abs. 2 Satz 4 KWG		§ 10 Abs. 2 Satz 4 KWG
0514	1.1.5.2a.03	(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze nach § 10 Abs. 2 Satz 3 KWG		§ 10 Abs. 2 Satz 3 KWG

Blatt 5

### 34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS = (2); HGB = (3))	Telefon:	

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
			(a) 01	02
0515	1.1.5.2a.04	(-) Kernkapitalinstrumente, die den Übergangsvorschriften gemäß § 64m Abs. 1 KWG unterliegen		§ 64m Abs. 1 KWG, einzubeziehen sind hier die in den Positionen 0144/01 und 0145/01 sowie 0455/01 und 0456/01 gemeldeten Instrumente
0516	1.1.5.3a	(-) Korrekturposten für Bewertungsanpassungen gemäß § 1a Abs. 8 KWG, soweit nicht bereits in der Rechnungslegung berücksichtigt		siehe BaFin-Rundschreiben zu § 1a Abs. 8 KWG
0520	1.1.5.4	<b>(-) Andere, landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital</b>		=1.1.5.4.1+1.1.5.4.2
0530	1.1.5.4.1	(-) Korrekturposten (negativ) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften		
0540	1.1.5.4.2	(-) Entnahmen der/ Kredite an Gesellschafter, sowie der Überschuss der Aktivposten über die Passivposten bei Zweigstellen von Unternehmen mit Sitz im Ausland		Abzugsposten nach § 10 Abs. 2a Satz 2 Nr. 4 und 5 KWG
0550	1.2	<b>Ergänzungskapital</b>		=1.2.1+1.2.2+1.2.3
0560	1.2.1	<b>Ergänzungskapital 1. Klasse</b>		=1.2.1.1+1.2.1.2+1.2.1.3+1.2.1.4+1.2.1.5+1.2.1.6+1.2.1.7+1.2.1.8
0570	1.2.1.1	<b>Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestandteile</b>		Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestandteile gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 7a KWG (siehe Position 0511/01) =-1.1.5.2a
0580	1.2.1.2	<b>Korrekturposten für aus dem Kernkapital übertragene Bewertungseffekte (Prudential Filters)</b>		1.2.1.2.01 bis 1.2.1.2.05
0590	1.2.1.2.01	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.02 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben
0600	1.2.1.2.02	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögenswerten		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.06 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben
0610	1.2.1.2.03	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.12 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben.
0620	1.2.1.2.04	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.14 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben
0630	1.2.1.2.05	Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen		betrifft Position 1.1.2.6.16

Blatt 6

**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs. 6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS = (2); HGB = (3))	Telefon:	

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
			(a) 01	02
0640	1.2.1.3	Nicht realisierte Reserven in Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden sowie in notierten Wertpapieren, in Verbundunternehmen und Investmentanteilen		Der Ausweis erfolgt hier unter Abzug der auf die gruppenangehörigen Unternehmen entfallenden nicht realisierten Reserven.
0650	1.2.1.4	Freie Vorsorgereserven nach § 340f HGB		
0660	1.2.1.5	Rücklagen nach § 6b des ESTG aus der Veräußerung von Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und		
0670	1.2.1.6	Kapital gemäß § 10 Abs. 5 KWG (abzüglich Marktpflegeposition)		Der Ausweis erfolgt unter Abzug des auf die gruppenangehörigen Unternehmen entfallenden Kapitals gemäß § 10 Abs. 5 KWG
0680	1.2.1.7	Berücksichtigungsfähiger Wertberichtigungsüberschuss für IRBA-Positionen gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 9 KWG		
0690	1.2.1.8	Kumulative Vorzugsaktien im Sinne des § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 2 KWG (abzgl. eigener kumulativer Vorzugsaktien)		Der Ausweis erfolgt unter Abzug der auf die gruppenangehörigen Unternehmen entfallenden Kapitalanteile aus kumulativen Vorzugsaktien
0700	1.2.2	Ergänzungskapital 2. Klasse		=1.2.2.1+1.2.2.2+1.2.2.3+1.2.2.4+1.2.2.5
0710	1.2.2.1	Haftsummenzuschlag		
0720	1.2.2.2	Kumulative Vorzugsaktien mit fester Laufzeit		
0730	1.2.2.3	Längerfristige nachrangige Verbindlichkeiten (abzüglich Marktpflegeposition)		Der Ausweis erfolgt unter Abzug der auf die gruppenangehörigen Unternehmen entfallenden längerfristigen nachrangigen Verbindlichkeiten
0740	1.2.2.4	Landesspezifische Ergänzungskapitalbestandteile 2. Klasse		
0750	1.2.2.5	(-) Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 2 Satz 7 KWG		§ 10 Abs. 2 Satz 7 KWG: Dabei darf das berücksichtigte Ergänzungskapital nur bis zu 50% des Kernkapitals aus längerfristigen nachrangigen Verbindlichkeiten und dem Haftsummenzuschlag bestehen.
0760	1.2.3	(-) Abzugspositionen von der Summe des Ergänzungskapitals		=1.2.3.1+1.2.3.2
0770	1.2.3.1	(-) Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 2 Satz 6 KWG		§ 10 Abs. 2 Satz 6 KWG: Bei der Berechnung des haftenden Eigenkapitals kann Ergänzungskapital nur bis zur Höhe des Kernkapitals berücksichtigt werden.
0780	1.2.3.2	(-) Sonstige im Ergänzungskapital zu berücksichtigende Abzugspositionen		1.2.3.2.1 + 1.2.3.2.2
0790	1.2.3.2.1	(-) Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 i.V.m. Abs. 3b KWG;		

Blatt 7

**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB =(3))		Telefon:

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
			01	02
0800	1.2.3.2.2	(-) Maximal 50% des aktivischen Unterschiedsbetrages gemäß § 10 a Abs. 6 Satz 9 und 10 KWG, der nicht wie eine Beteiligung an einem fremden Unternehmen behandelt wird		
0810	1.3	(-) Abzugspositionen vom Kern- und Ergänzungskapital		1.3.1 bis 1.3.11 Die Abzüge erfolgen zumindest zu 50% vom Kernkapital und höchstens zu 50% vom Ergänzungskapital
0820	1.3.T1*	davon: (-) Vom Kernkapital		Der sich gegebenenfalls ergebende negative Ergänzungskapitalsaldo nach § 10 Abs. 2a Satz 2 Nr. 7 KWG ist vom Kernkapital abzuziehen und hier zu berücksichtigen.
0830	1.3.T2*	davon: (-) Vom Ergänzungskapital		Sofern 50% des Betrages der Pos. 1.3 den Betrag von Pos. 1.2 übersteigt, so ist dieser negative Ergänzungskapitalsaldo (§ 10 Abs. 2a Satz 2 Nr. 7 KWG) vom Kernkapital abzuziehen, was durch Berücksichtigung in Pos. 1.3.T1* erfolgt.
0840	1.3.1	(-) Beteiligungen gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 1 KWG		
0850	1.3.2	(-) Forderungen aus nachrangigen Verbindlichkeiten und Kapitalgewährungen nach § 10 Abs. 5 KWG sowie Kapitalgewährungen nach § 10 Abs. 2a Satz 1 Nrn. 8 und 10 KWG gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 2 und 3 KWG		
0860	1.3.3	(-) Beteiligungen, Forderungen aus nachrangigen Verbindlichkeiten und Kapitalgewährungen nach § 10 Abs. 5 KWG sowie Kapitalgewährungen nach § 10 Abs. 2a Satz 1 Nrn. 8 und 10 KWG gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 4 Buchstabe a bis c KWG		
0870	1.3.4	(-) Beteiligungen gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 5 KWG		
0880	1.3.5	(-) Forderungen aus nachrangigen Verbindlichkeiten und Genussrechten gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 6 KWG		
0890	1.3.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Kern- und Ergänzungskapital		
0900	1.3.LE	nachrichtlich: Haftendes Eigenkapital nach § 10 Abs. 1d Satz 3 KWG (Bemessungsgrundlage für die Großkreditgrenze im Anlagebuch, für qualifizierte Beteiligungen außerhalb des Finanzsektors sowie für Organkredite)		=1.1+(1.2-1.2.1.7)+1.3.1+1.3.2+1.3.3+1.3.4+1.3.5+1.3.6

Blatt 8



**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB =(3))	Telefon:	

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0910	1.3.7	(-) Verbriefungspositionen, auf die ein Risikogewicht von 1250% angewandt wird und die bei der Ermittlung der risikogewichteten Aktiva oder bei der Ermittlung des Teilanrechnungsbetrags für das besondere Kursrisiko Zinsnettoposition nicht berücksichtigt worden sind		
0920	1.3.8	(-) Wertberichtigungsfehlbeträge und erwartete Verlustbeträge für IRBA-Positionen gemäß § 10 Abs. 6a Nr. 1 und Nr. 2 KWG		
0930	1.3.9	(-) Qualifizierte Beteiligungen nach § 12 KWG		
0940	1.3.10	(-) Abzugsposition gemäß § 10 Abs. 6a Nr. 4 KWG		
0950	1.3.11	(-) Großkreditüberschreitungen des Anlagebuches sowie Unterlegungsbeträge für Organkredite nach § 15 KWG		
0960	1.4	<b>Kernkapital (gesamt) für Solvenzzwecke</b>		= 1.1+1.3.T1* Darüber hinaus sind hier die Beträge aus Pos. 1.7 als Abzugspositionen zu erfassen, die mit Kernkapital unterlegt werden.
0970	1.5	<b>Ergänzungskapital (gesamt) für Solvenzzwecke</b>		=1.2+1.3.T2* Darüber hinaus sind hier die Beträge aus Pos. 1.7 als Abzugspositionen zu erfassen, die mit Ergänzungskapital unterlegt werden.
0980	1.6	<b>Genutzte, verfügbare Drittrangmittel</b>		=1.6.1+1.6.2+1.6.3+1.6.4+1.6.5+1.6.6+1.6.7
0990	1.6.1	Positionen gemäß § 10 Abs. 2c Satz 1 Nr. 3 KWG		§ 10 Abs. 2c Nr. 3 KWG: <i>Positionen, die allein wegen einer Kappung nach Absatz 2 Satz 6 und 7 nicht als Ergänzungskapital berücksichtigt werden können.</i>
1000	1.6.2	Nettogewinn		
1010	1.6.3	Kurzfristige nachrangige Verbindlichkeiten (abzüglich Marktpflegeposition)		Der Ausweis erfolgt unter Abzug der auf die gruppenangehörigen Unternehmen entfallenden kurzfristigen nachrangigen Verbindlichkeiten
1020	1.6.4	(-) Schwer realisierbare Aktiva sowie Verluste von Tochterunternehmen gemäß § 10 Abs. 2c Satz 4 KWG		
1030	1.6.5	(-) Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 2c Satz 2 und 3 KWG		Dritrangmittel + freies EK < 2,5 x FKK (Satz 2) bzw. 2 x FKK (Satz 3)
1040	1.6.LE	nachrichtlich: <i>Eigenmittel für die Großkreditgrenze im Gesamtbuch</i>		=1.3.LE+1.6.1+1.6.2+1.6.3+1.6.4+1.6.5
1050	1.6.6	Berücksichtigung sonstiger Positionen bei der Berechnung der genutzten, verfügbaren Drittrangmittel		1.6.6.1

**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB = (3))	Telefon:	

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
			01	02
1060	1.6.6.1	(-) Großkredit-Überschreitungen aus kreditnehmerbezogenen Handelsbuch- und Gesamtbuchpositionen, soweit sie mit Drittrangmitteln unterlegt werden		
1080	1.6.7	(-) Ungenutzte, aber verfügbare Drittrangmittel		
1090	1.7	<i>(-) Abzüge von der Summe des haftenden Eigenkapitals</i>		1.7.1 + 1.7.2
1100	1.7.1	(-) Großkredit-Überschreitungen aus kreditnehmerbezogenen Handelsbuch- und Gesamtbuchpositionen, die mit haftendem Eigenkapital unterlegt werden		Handelsbuchinstitute erfassen hier den Teil der Großkredit-Überschreitungen aus kreditnehmerbezogenen Handelsbuch- und Gesamtbuchpositionen (§ 13a Abs. 4 und Abs. 5 KWG), der mit haftendem Eigenkapital unterlegt wird.
1110	1.7.2	Beteiligungen an Versicherungsunternehmen		
1120	1.8	nachrichtlich:		
	1.8.1	<i>IRB-Wertberichtigungsüberschuss (+) / -fehlbetrag (-)</i>		=1.8.1.1+1.8.1.2
1130	1.8.1.1	<i>für IRB-Positionen gebildete Wertberichtigungen</i>		
1140		davon:		
	1.8.1.1*	<i>Pauschalwertberichtigungen</i>		
1150	1.8.1.1**	davon:		
		<i>Einzelwertberichtigungen</i>		
1160	1.8.1.1***	davon:		
		<i>Vorsorgereserven nach § 340 f HGB</i>		
1170	1.8.1.2	<i>(-) Erwartete Verlustbeträge für IRB-Positionen</i>		
1180	1.8.2	<b>Bruttobetrag der längerfristigen nachrangigen Verbindlichkeiten</b>		
1190	1.8.3	<b>Mindestanfangskapital</b>		

Blatt 10

**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB =(3))		Telefon:

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
			01	02
1200	2	Eigenmittelanforderungen		=2.1+2.2+2.3+2.4+2.5+2.6 davon nach Zeile 2a: Max [2.1+2.2+2.3+2.6, 2.5] davon nach Zeile 2b: = 2.1+2.2+2.3+2.5+2.6 davon nach Zeile 2c: = 2.1 + 2.2 + 2.3 + Min[2.4,(12/88)*max(2.1+2.2+2.3, 2.5)] + 2.6; bei Anwendung von § 339 Abs. 7 Satz 2 Nr. 2 SolvV ist § 339 Abs. 7 Satz 3 SolvV zu berücksichtigen
1210	2a	darunter: Eigenmittelanforderungen nach § 2 Abs. 4 SolvV bei Finanzdienstleistungsinstituten		Max [2.1+2.2+2.3+2.6, 2.5]
1220	2b	darunter: Eigenmittelanforderungen bei Anwendung von § 269 Abs. 3 SolvV bei Finanzdienstleistungsinstituten		2.1+2.2+2.3+2.5+2.6
1230	2c	darunter: Eigenmittelanforderungen bei Anwendung der Übergangsregelung nach § 339 Abs. 7 Satz 2 und 3 SolvV bei Finanzdienstleistungsinstituten, die nicht unter den Anwendungsbereich des § 269 Abs. 3 SolvV fallen		"= 2.1 + 2.2 + 2.3 + Min[2.4,(12/88)*max(2.1+2.2+2.3, 2.5)] + 2.6; bei Anwendung von § 339 Abs. 7 Satz 2 Nr. 2 SolvV ist § 339 Abs. 8 Satz 3 SolvV zu berücksichtigen
1240	2.1	Eigenkapitalanforderungen (gesamt) für Adressenausfallrisiken		=2.1.1+2.1.2
1250	2.1.1	Kreditrisiko-Standardansatz (KSA)		=2.1.1.1a +2.1.1.2
1260	2.1.1.1a	KSA-Forderungsklassen (ohne Verbriefungen)		Anlage 3 Nr. 35 Zelle 010/ 22
1270	2.1.1.1a.01	Zentralregierungen		Anlage 3 Nr. 36 Zelle 010/ 22
1280	2.1.1.1a.02	Regionalregierungen und örtliche Gebietskörperschaften		Anlage 3 Nr. 37 Zelle 010/ 22
1290	2.1.1.1a.03	sonstige öffentliche Stellen		Anlage 3 Nr. 38 Zelle 010/ 22
1300	2.1.1.1a.04	multilaterale Entwicklungsbanken		Anlage 3 Nr. 39 Zelle 010/ 22
1310	2.1.1.1a.05	Internationale Organisationen		Anlage 3 Nr. 40 Zelle 010/ 22
1320	2.1.1.1a.06	Institute		Anlage 3 Nr. 41 Zelle 010/ 22
1330	2.1.1.1a.07	Unternehmen		Anlage 3 Nr. 43 Zelle 010/ 22
1340	2.1.1.1a.08	Mengengeschäft		Anlage 3 Nr. 44 Zelle 010/ 22
1350	2.1.1.1a.09	durch Immobilien besicherte Positionen		Anlage 3 Nr. 45 Zelle 010/ 22
1360	2.1.1.1a.10	überfällige Positionen		Anlage 3 Nr. 49 Zelle 010/ 22
1370	2.1.1.1a.11	Beteiligungen		Anlage 3 Nr. 47 Zelle 010/ 22
1380	2.1.1.1a.12	von Kreditinstituten emittierte gedeckte Schuldverschreibungen		Anlage 3 Nr. 42 Zelle 010/ 22

Blatt 11

**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB =(3))	Telefon:	

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
1390	2.1.1.1a.13	kurzfristige Forderungen an Unternehmen (sind in der Forderungsklasse "Unternehmen" mit aufzuführen)		
1400	2.1.1.1a.14	Investmentanteile		Anlage 3 Nr. 46 Zeile 010/ 22
1410	2.1.1.1a.15	sonstige Positionen		Anlage 3 Nr. 48 Zeile 010/ 22
1420	2.1.1.1b	<b>IRBA-Forderungsklassen (ohne Verbriefungen)</b>		
1430	2.1.1.1b.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		
1440	2.1.1.1b.02	Institute		
1450	2.1.1.1b.03	Unternehmen		
1460	2.1.1.1b.04	Mengengeschäft		
1470	2.1.1.1b.05	Beteiligungen		
1480	2.1.1.1b.06	Sonstige kreditunabhängige Aktiva		
1490	2.1.1.2	<b>KSA-Verbriefungstransaktionen</b>		Anlage 3 Nr. 50 Zeile 010/33
1491	2.1.1.2*	<b>darunter: Wiederverbriefungen</b>		Anlage 3 Nr. 50 Zeile 011/33
1500	2.1.2	<b>Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRBA)</b>		=2.1.2.1+2.1.2.2+2.1.2.3+2.1.2.4+2.1.2.5
1510	2.1.2.1	<b>IRB-Ansatz, wenn eigene Schätzungen weder für die Ermittlung der Verlustquote bei Ausfall noch für IRBA-Konversionsfaktoren genutzt werden</b>		2.1.2.1.01 bis 2.1.2.1.03 Anlage 3 Nr. 51a Zeile 010/24
1520	2.1.2.1.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		Anlage 3 Nr. 52a Zeile 010/ 24
1530	2.1.2.1.02	Institute		Anlage 3 Nr. 53a Zeile 010/ 24
1540	2.1.2.1.03	Unternehmen		Anlage 3 Nr. 55a Zeile 010/ 24
1550	2.1.2.2	<b>IRB-Ansatz, wenn eigene Schätzungen für die Ermittlung der Verlustquote bei Ausfall und/oder der IRBA-Konversionsfaktoren genutzt werden</b>		2.1.2.2.01 bis 2.1.2.2.04 Anlage 3 Nr. 51 Zeile 010/24
1560	2.1.2.2.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		Anlage 3 Nr. 52 Zeile 010/ 24
1570	2.1.2.2.02	Institute		Anlage 3 Nr. 53 Zeile 010/ 24
1580	2.1.2.2.03	Unternehmen		Anlage 3 Nr. 55 Zeile 010/ 24
1590	2.1.2.2.04	Mengengeschäft		Anlage 3 Nr. 54 Zeile 010/ 24
1600	2.1.2.3	<b>Beteiligungen</b>		Anlage 3 Nr. 57 Zeile 010/ 13
1610	2.1.2.4	<b>IRBA-Verbriefungspositionen</b>		Anlage 3 Nr. 58 Zeile 010/ 39
1611	2.1.2.4*	<b>darunter: Wiederverbriefungen</b>		Anlage 3 Nr. 58 Zeile 011/ 39

Blatt 12

**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB = (3))	Telefon:	

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
1620	2.1.2.5	<i>Sonstige kreditunabhängige Aktiva</i>		keine Verknüpfung mit einem anderen Meldebogen
1630	2.2	<i>Abwicklungsrisiken</i>		2.2.1 und 2.2.2
1631	2.2.1	<i>Abwicklungsrisiken im Anlagebuch</i>		Anlage 3 Nr. 60 Zelle 011/ 03
1632	2.2.2	<i>Abwicklungsrisiken im Handelsbuch</i>		Anlage 3 Nr. 60 Zelle 070/ 03
1640	2.3	<i>Eigenmittelanforderungen für Marktrisikopositionen</i>		2.3.1 und 2.3.2
1650	2.3.1	<i>Eigenmittelanforderungen für die Marktrisikopositionen nach den Standardverfahren</i>		2.3.1.1 bis 2.3.1.4
1660	2.3.1.1	<i>Zinsnettoposition</i>		2.3.1.1.01 bis 2.3.1.1.03 Darüber hinaus sind hier die Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach der Szenario Matrix Methode zu erfassen
1661	2.3.1.1.01	<i>Allgemeines und besonderes Kursrisiko Zinsnettoposition</i>		Anlage 3 Nr. 65 Zellen 300/01, 420/05 und 520/03
1662	2.3.1.1.02	<i>Besonderes Kursrisiko Verbriefungspositionen im Handelsbuch</i>		Anlage 3 Nr. 70 Zelle 010/61
1663	2.3.1.1.03	<i>Besonderes Kursrisiko Correlation Trading Portfolio</i>		Anlage 3 Nr. 71 Zelle 010/45
1670	2.3.1.2	<i>Aktiennettoposition</i>		Anlage 3 Nr. 66 Zelle 110/07. Darüber hinaus sind hier die Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach der Szenario Matrix Methode zu erfassen
1680	2.3.1.3	<i>Währungsgesamtposition</i>		Anlage 3 Nr. 63 Zelle 99001. Darüber hinaus sind hier die Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach der Szenario Matrix Methode zu erfassen
1690	2.3.1.4	<i>Rohwarenposition</i>		Anlage 3 Nr. 64 Zelle 360/03. Darüber hinaus sind hier die Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach der Szenario Matrix Methode zu erfassen
1700	2.3.2	<i>Eigenmittelanforderungen für die Marktrisikopositionen bei Verwendung eines eigenen Risikomodells</i>		Anlage 3 Nr. 62 Zelle 010/05
1710	2.4	<i>Eigenkapitalanforderungen für das operationelle Risiko</i>		=2.4.1+2.4.2+2.4.3
1720	2.4.1	<i>Basisindikatoransatz</i>		Anlage 3 Nr. 61 Zelle 010/07
1730	2.4.2	<i>Standardansatz/alternativer Standardansatz</i>		Anlage 3 Nr. 61 Zelle 020/07
1740	2.4.3	<i>Fortgeschrittene Messansätze</i>		Anlage 3 Nr. 61 Zelle 130/07
1750	2.5	<i>Verwaltungskostenbasierte Eigenmittelanforderung gemäß § 10 Abs. 9 Satz 1 und 2 KWG</i>		
1760	2.6	<i>Sonstige oder übergangsweise Eigenkapitalanforderungen</i>		2.6.2 + 2.6.3

Blatt 13

**34. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG i.V.m. § 10a KWG, zu den Adressrisiken, zu den Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)**

Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanzholding-Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:	
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG (IAS =(2); HGB = (3))		Telefon:

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
1770	2.6.1	Zusätzliche Eigenkapitalanforderungen aufgrund der Regelung in § 339 Abs. 5a und 5b SolvV		
1780	2.6.2	Zusätzliche Eigenkapitalanforderungen aufgrund der Regelung in § 339 Abs. 7 Satz 4 SolvV		
1790	2.6.3	Eigenmittelanforderungen für "Andere Marktrisikopositionen"		Keine Verknüpfung mit einem anderen Meldebogen; einzutragen sind hier die nach § 312 SolvV zu ermittelnden Eigenmittelanforderungen für andere Marktrisikopositionen; Darüber hinaus sind hier die Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach der Szenario Matrix Methode zu erfassen
	3	Nachrichtlich:		
1800	3.1	Überschuss (+) / Defizit (-) der Eigenmittel vor sonstigen und übergangsweise Eigenkapitalanforderungen		=1-(2 - 2.6)
1810	3.1a	Gesamtkennziffer (%) vor sonstigen und übergangsweise Eigenkapitalanforderungen		=1/ (2 - 2.6) * 8
1820	3.2	Überschuss (+) / Defizit (-) der Eigenmittel		=1-2
1830	3.2.a	Gesamtkennziffer (%)		=1 / 2 * 8
1840	3.3	Überschuss (+) / Defizit (-) der Eigenmittel unter Berücksichtigung des SRP		
1850	3.3a	Gesamtkennziffer als Index (%) unter Berücksichtigung des SRP		
1860	3.4	Interne Einschätzung der Risikotragfähigkeit: Überschuss(+)/ Defizit (-) des internen Kapitals		
1870	3.4.1	Risikodeckungspotential		
1880	3.4.2	Interne Einschätzung der Kapitalanforderungen		

(a) Jeder Betrag, der die Eigenmittel oder die Eigenmittelanforderungen erhöht, hat ein positives Vorzeichen. Jeder Betrag, der die Eigenmittel oder die Eigenmittelanforderungen reduziert, hat ein negatives Vorzeichen.(BKH)

Blatt 14

**35. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA QS  
Blatt 1**

<b>KSA-Forderungsklasse:</b>	<b>Summenblatt (Anlage 3 Nr. 36 - 49)</b>	<b>Institutsnummer:</b>	<input type="text"/>	<b>Prüfziffer:</b>	<input type="text"/>	<b>Übergeordnetes Unternehmen:</b>	<input type="text"/>
<b>Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:</b>	<input type="text"/>	<b>Stand Ende:</b>	<input type="text"/>	<b>Sachbearbeiter/in:</b>	<input type="text"/>	<b>Telefon:</b>	<input type="text"/>

in Mio Euro

					Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten		
					Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge		Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Substitutionseffekte		
					Garantien	Kreditderivate			Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	
					05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10	11=04+09+10
010	Gesamtsumme										
	Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position										
	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV  Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen  Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV  Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV  Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV										
020											
030											
040											
050											
060											
070	Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten										
080	0%										
090	10%										
100	20%										
110	35%										
120	50%										
130	darunter: Überfällige Positionen										
140	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
150	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen										
160	70%										
170	75%										
180	100%										
190	darunter: Überfällige Positionen										
200	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
210	Durch Immobilien besicherte Positionen										
220	150%										
230	darunter: Überfällige Positionen										
	200%										
	Sonstige Risikogewichte										

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**35. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA QS  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse:

Summenblatt (Anlage 3  
Nr. 36 - 49)

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes  
Unternehmen:

Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktoren für Sicherungsinstrumente		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
010	<b>Gesamtsumme</b>											Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>												
020	<b>Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV</b>											
030	<b>Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen</b>											
040	<b>Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV</b>											
050	<b>Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV</b>											
060	<b>Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV</b>											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>												
070	<b>0%</b>											
080	<b>10%</b>											
090	<b>20%</b>											
100	<b>35%</b>											
110	<b>50%</b>											
120	<i>darunter: Überfällige Positionen</i>											
130	<i>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</i>											
140	<i>Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen</i>											
145	<b>70%</b>											
150	<b>75%</b>											
160	<b>100%</b>											
170	<i>darunter: Überfällige Positionen</i>											
180	<i>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</i>											
190	<i>Durch Immobilien besicherte Positionen</i>											
200	<b>150%</b>											
210	<i>darunter: Überfällige Positionen</i>											
220	<b>200%</b>											
230	<b>Sonstige Risikogewichte</b>											



**36. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q1  
Blatt 1**

KSA-Forderungsklasse: **Zentralregierungen**      Institutsnummer:       Prüfziffer:       Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe /       Stand:       Sachbearbeiter/in:       Telefon:   
Finanzholding-Gruppe:       Ende:

in Mio Euro

in Mio. Euro												
	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen										
		Substitutionseffekte		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Kreditderivate	Garantien	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen
		11=04+09+10	10	09 = 05+06+07+08	08	07	06	05	04=01+03	03	02	01
010	Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV											
030												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**36. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q1  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse: **Zentralregierungen**

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschwindungsrisikofaktor (FIE) nach § 188 SolvV	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitpassungsfaktor für Sicherheitsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
						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
010 <b>Gesamtsumme</b>												Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>												
020 <b>Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV</b>												
030 <b>Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen</b>												
040 <b>Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV</b>												
050 <b>Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV</b>												
060 <b>Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV</b>												
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>												
070 <b>0%</b>												
080 <b>10%</b>												
090 <b>20%</b>												
100 <b>35%</b>												
110 <b>50%</b>												
120 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
130 <b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>												
140 <b>Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen</b>												
145 <b>70%</b>												
150 <b>75%</b>												
160 <b>100%</b>												
170 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
180 <b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>												
190 <b>Durch Immobilien besicherte Positionen</b>												
200 <b>150%</b>												
210 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
220 <b>200%</b>												
230 <b>Sonstige Risikogewichte</b>												

**KSA Q2**  
**Blatt 1**

**KSA-Forderungsklasse:** Regionalregierungen und  
örtliche  
Gebietskörperschaften      Institutsnr.:       Prüzfzfr.:       Übergeordnetes  
Unternehmen:

Institutgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:       Stand:  
Ende:       Sachbearbeiter/in:       Telefon:

in Mio Euro

in Mio Euro											
KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekte										
	Substitutionseffekte		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten (§ 49 Abs. 2 SolV)	(-) Werberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten (§ 49 Abs. 2 SolV) zzgl. Werberichtigungen und Rückstellungen	
	Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge			Garantien	Kreditderivate					
	09 = 05+06+07+08	10	08	07	06	05	04=01+03	03	02	01	
010	Gesamtsumme										
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV										
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen										
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV										
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV										
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV										
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten											
070	0%										
080	10%										
090	20%										
100	35%										
110	50%										
120	darunter: Überfällige Positionen										
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen										
145	70%										
150	75%										
160	100%										
170	darunter: Überfällige Positionen										
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
190	Durch Immobilien besicherte Positionen										
200	150%										
210	darunter: Überfällige Positionen										
220	200%										
230	Sonstige Risikogewichte										

123

**37. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q2  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse: Regionalregierungen und  
örtliche  
Gebietskörperschaften

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschonungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (FIE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(+) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherheitsinstrumente	0%	20%	50%	100%	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19		
010	<b>Gesamtsumme</b>										Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>											
020	<b>Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV</b>										
030	<b>Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen</b>										
040	<b>Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV</b>										
050	<b>Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV</b>										
060	<b>Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV</b>										
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>											
070	<b>0%</b>										
080	<b>10%</b>										
090	<b>20%</b>										
100	<b>35%</b>										
110	<b>50%</b>										
120	<b>darunter: Überfällige Positionen</b>										
130	<b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>										
140	<b>Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen</b>										
145	<b>70%</b>										
150	<b>75%</b>										
160	<b>100%</b>										
170	<b>darunter: Überfällige Positionen</b>										
180	<b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>										
190	<b>Durch Immobilien besicherte Positionen</b>										
200	<b>150%</b>										
210	<b>darunter: Überfällige Positionen</b>										
220	<b>200%</b>										
230	<b>Sonstige Risikogewichte</b>										

**38. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q3  
Blatt 1**

<b>KSA-Forderungsklasse:</b>	<b>sonstige öffentliche Stellen</b>	Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>	Übergeordnetes Unternehmen:	<input type="text"/>
<b>Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:</b>	<input type="text"/>	Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>	Telefon:	<input type="text"/>

in Mio Euro

in Mio Euro													
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Werberichtigungen und Rückstellungen (§ 49 Abs. 2 SolV) zzgl. Werberichtigungen und Rückstellungen	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Werberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen								KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge		Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Substitutionseffekte				
					Garantien	Kreditderivate			(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge			
		01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10	11=04+09+10	
010	Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position													
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV												
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV												
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV												
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV												
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten													
070	0%												
080	10%												
090	20%												
100	35%												
110	50%												
120	darunter: Überfällige Positionen												
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur												
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen												
145	70%												
150	75%												
160	100%												
170	darunter: Überfällige Positionen												
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur												
190	Durch Immobilien besicherte Positionen												
200	150%												
210	darunter: Überfällige Positionen												
220	200%												
230	Sonstige Risikogewichte												

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**38. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q3  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse:

sonstige öffentliche  
Stellen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes  
Unternehmen:

Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungs- grundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen		
			0%	20%	50%	100%					
	Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (FE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(+) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungs- und berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherheitsinstrumente	15=11+12 +13	0%	20%	50%	100%	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	<b>Gesamtsumme</b>										Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>											
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV										
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen										
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV										
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV										
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV										
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>											
070	0%										
080	10%										
090	20%										
100	35%										
110	50%										
120	darunter: Überfällige Positionen										
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen										
145	70%										
150	75%										
160	100%										
170	darunter: Überfällige Positionen										
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
190	Durch Immobilien besicherte Positionen										
200	150%										
210	darunter: Überfällige Positionen										
220	200%										
230	Sonstige Risikogewichte										

**39. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q4  
Blatt 1**

**KSA-Forderungsklasse:**  **Institutsnummer:**  **Prüfziffer:**  **Übergeordnetes Unternehmen:**

**Institutsgruppe:**  **Stand Ende:**  **Sachbearbeiter/in:**  **Telefon:**

**Finanzholding-Gruppe:**

in Mio Euro

KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten												
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von												

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**39. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q4  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse:       Institutsnummer:       Prüfziffer:       Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe/Finanzholding-Gruppe:       Stand Ende:       Sachbearbeiter/in:       Telefon:

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungsstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungsstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positions-wert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positions-wert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschwindungs-faktor (VF) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge		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
010	<b>Gesamtsumme</b>											Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>												
020	<b>Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV</b>											
030	<b>Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen</b>											
040	<b>Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV</b>											
050	<b>Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV</b>											
060	<b>Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV</b>											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	<b>Sonstige Risikogewichte</b>											



**40. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q5  
Blatt 1**

<b>KSA-Forderungsklasse:</b>	<b>internationale Organisationen</b>	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
<b>Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:</b>		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

in Mio. Euro												
	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen										
		Substitutionseffekte		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Kreditderivate	Garantien	Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	11=04+09+10	
		(-) Gesamtsumme der Abgänge										
	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV) zzgl. Werberichtigungen und Rückstellungen		darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Werberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV)	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge						
	01	02			04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10	
010	Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV											
030		Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen										
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitenansprüchen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**40. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q5  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse:  internationale Organisationen      Institutsnr.:       Prüfziffer:       Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:       Stand Ende:       Sachbearbeiter/in:       Telefon:

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschwanungskursfaktor (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und lautezeitbereinigte Beträge	(+) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Konversionsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente		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
010	<b>Gesamtsumme</b>											Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

**41. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q6  
Blatt 1**

**KSA-Forderungsklasse:**       Institutsnummer:       Prüfziffer:       Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe/       Stand       Sachbearbeiter/in:       Telefon:

Finanzholding-Gruppe:       Ende:

in Mio Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV) zzgl. Werberichtigungen und Rückstellungen	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Werberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV)	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen				Substitutionseffekte		KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten
					Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge		
										Garantien	
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10	11=04+09+10
010	Gesamtsumme										
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV										
030		Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen									
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitenzuschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV										
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV										
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV										
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten											
070	0%										
080	10%										
090	20%										
100	35%										
110	50%										
120	darunter: Überfällige Positionen										
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen										
145	70%										
150	75%										
160	100%										
170	darunter: Überfällige Positionen										
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
190	Durch Immobilien besicherte Positionen										
200	150%										
210	darunter: Überfällige Positionen										
220	200%										
230	Sonstige Risikogewichte										

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**41. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q6  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse:       Institutsnummer:       Prüzfiffer:       Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:       Stand Ende:       Sachbearbeiter/in:       Telefon:

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungsstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungsstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschonungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeibereinigte Beträge	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeilassungsinsturmente		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
010	<b>Gesamtsumme</b>											Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

**42. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q7  
Blatt 1**

<b>KSA-Forderungsklasse:</b>	von Kreditinstituten emittierte gedeckte Schuldverschreibungen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
<b>Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:</b>		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

in Mio. Euro												
	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekte bei den KSA-Bemessungsgrundlagen								KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten		
		Substitutionseffekte		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Kreditderivate	Garantien				
		(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge									
		09 = 05+06+07+08	10		05	06	07	08	04=01+03	03	02	01
010	Gesamtsumme											
020	Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position											
030	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
040		Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen										
050	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitenansprüchen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
060	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
070	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
080	Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten											
090	0%											
100	10%											
110	20%											
120	35%											
130	50%											
140	darunter: Überfällige Positionen											
150	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
160	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
170	70%											
180	75%											
190	100%											
200	darunter: Überfällige Positionen											
210	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
220	Durch Immobilien besicherte Positionen											
230	150%											
240	darunter: Überfällige Positionen											
250	200%											
260	Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**42. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q7  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse:

von Kreditinstituten emittierte  
gedeckte  
Schuldverschreibungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes  
Unternehmen:

Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

	Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen	
	Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherheitsinstrumente		0%	20%	50%	100%				
												12
010 Gesamtsumme												Übertrag UB Meldebogen
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position												
020 Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030 Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen												
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitsnachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
050 Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsverein-barungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten												
070 0%												
080 10%												
090 20%												
100 35%												
110 50%												
120 darunter: Überfällige Positionen												
130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur												
140 Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen												
145 70%												
150 75%												
160 100%												
170 darunter: Überfällige Positionen												
180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur												
190 Durch Immobilien besicherte Positionen												
200 150%												
210 darunter: Überfällige Positionen												
220 200%												
230 Sonstige Risikogewichte												

**43. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q8  
Blatt 1**

KSA-Forderungsklasse: **Unternehmen**      Institutsnummer:       Prüfziffer:       Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe:       Stand Ende:       Sachbearbeiter/in:       Telefon:

Finanzholding-Gruppe:

in Mio Euro

						Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen						KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
					KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV)	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge		Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen, Inkongruenzenbereinigte Beträge	Substitutionseffekte		
				(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden		Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode		Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	
					04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10	11=04+09+10
010	Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**43. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q8  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse: **Unternehmen**      Institutsnr.:       Prüfziffer:       Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:       Stand Ende:       Sachbearbeiter/in:       Telefon:

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungs- und Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktoren für Sicherungsinstrumente		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
010	<b>Gesamtsumme</b>											Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>												
020	<b>Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV</b>											
030	<b>Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen</b>											
040	<b>Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV</b>											
050	<b>Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV</b>											
060	<b>Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV</b>											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>												
070	<b>0%</b>											
080	<b>10%</b>											
090	<b>20%</b>											
100	<b>35%</b>											
110	<b>50%</b>											
120	<i>darunter: Überfällige Positionen</i>											
130	<i>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</i>											
140	<i>Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen</i>											
145	<b>70%</b>											
150	<b>75%</b>											
160	<b>100%</b>											
170	<i>darunter: Überfällige Positionen</i>											
180	<i>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</i>											
190	<i>Durch Immobilien besicherte Positionen</i>											
200	<b>150%</b>											
210	<i>darunter: Überfällige Positionen</i>											
220	<b>200%</b>											
230	<b>Sonstige Risikogewichte</b>											



**44. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q9  
Blatt 1**

<b>KSA-Forderungsklasse:</b>	<b>Mengengeschäft</b>	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
<b>Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:</b>		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

in Mio. Euro												
	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen										
		Substitutionseffekte		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Kreditderivate	Garantien	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen
		11=04+09+10	10	09 = 05+06+07+08	08	07	06	05	04=01+03	03	02	01
010	Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV											
030												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**44. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q9  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse:       Institutsnummer:       Prüzfiffer:       Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:       Stand Ende:       Sachbearbeiter/in:       Telefon:

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschlechterungsfaktor (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente		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
010	<b>Gesamtsumme</b>											Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

**45. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q10  
Blatt 1**

KSA-Forderungsklasse:  durch Immobilien besicherte Positionen Institutsnummer:  Prüfziffer:  Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe/  Stand  Sachbearbeiter/in:  Telefon:   
Finanzholding-Gruppe:  Ende:

in Mio Euro

	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV) zzgl. Werberichtigungen und Rückstellungen	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV) zzgl. Werberichtigungen und Rückstellungen	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 49 Abs. 2 SolV) zzgl. Werberichtigungen und Rückstellungen	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen						KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	
				Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge		Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Substitutionseffekte		Gesamtsumme der Zugänge	
				Garantien	Kreditderivate			(-) Gesamtsumme der Abgänge			
	01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10	11=04+09+10
010 <b>Gesamtsumme</b>											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>											
020 <b>Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV</b>											
030 <b>Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen</b>											
040 <b>Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV</b>											
050 <b>Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV</b>											
060 <b>Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV</b>											
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>											
070 <b>0%</b>											
080 <b>10%</b>											
090 <b>20%</b>											
100 <b>35%</b>											
110 <b>50%</b>											
120 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>											
130 <b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>											
140 <b>Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen</b>											
145 <b>70%</b>											
150 <b>75%</b>											
160 <b>100%</b>											
170 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>											
180 <b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>											
190 <b>Durch Immobilien besicherte Positionen</b>											
200 <b>150%</b>											
210 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>											
220 <b>200%</b>											
230 <b>Sonstige Risikogewichte</b>											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Seite 1

**45. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q10  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse: **durch Immobilien  
besicherte Positionen**

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes  
Unternehmen:

Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

	Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (FIE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(+/-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherheitsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
						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
010 <b>Gesamtsumme</b>												Übertrag UB Meldbogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position</b>												
020 <b>Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV</b>												
030 <b>Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen</b>												
040 <b>Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV</b>												
050 <b>Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV</b>												
060 <b>Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV</b>												
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten</b>												
070 <b>0%</b>												
080 <b>10%</b>												
090 <b>20%</b>												
100 <b>35%</b>												
110 <b>50%</b>												
120 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
130 <b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>												
140 <b>Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen</b>												
145 <b>70%</b>												
150 <b>75%</b>												
160 <b>100%</b>												
170 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
180 <b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>												
190 <b>Durch Immobilien besicherte Positionen</b>												
200 <b>150%</b>												
210 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
220 <b>200%</b>												
230 <b>Sonstige Risikogewichte</b>												

Seite 2

**46. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q11  
Blatt 1**

**KSA-Forderungsklasse:**  **Institutsnummer:**  **Prüfziffer:**  **Übergeordnetes Unternehmen:**

**Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:**  **Stand Ende:**  **Sachbearbeiter/in:**  **Telefon:**

in Mio Euro

in Mio. Euro												
	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekte bei den KSA-Bemessungsgrundlagen										
		Substitutionseffekte		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Kreditderivate	Garantien	Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge		
		(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge									
		01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10	11=04+09+10
010	Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030		Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen										
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten												
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**46. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q11  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse: **Investmentanteile**

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

	Kreditrisikominderungs- techniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	KSA-Bemessungs- grundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungs- techniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA- Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
			0%	20%	50%	100%			
	<div>Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschwan- kungsfaktor (HE) nach § 188 SolvV</div> <div>(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und lauteilbereinigte Beträge</div> <div>(+) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Konversionsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente</div>	15=11+12 +13	0%	20%	50%	100%	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	<b>Gesamtsumme</b>								Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>									
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV								
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen								
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV								
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV								
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV								
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>									
070	0%								
080	10%								
090	20%								
100	35%								
110	50%								
120	darunter: Überfällige Positionen								
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur								
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen								
145	70%								
150	75%								
160	100%								
170	darunter: Überfällige Positionen								
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur								
190	Durch Immobilien besicherte Positionen								
200	150%								
210	darunter: Überfällige Positionen								
220	200%								
230	Sonstige Risikogewichte								

**47. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q12  
Blatt 1**

**KSA-Forderungsklasse:**  **Beteiligungen** **Institutsnummer:**  **Prüfziffer:**  **Übergeordnetes Unternehmen:**

**Institutsgruppe:**  **Stand Ende:**  **Sachbearbeiter/in:**  **Telefon:**

**Finanzholding-Gruppe:**

in Mio Euro

						Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen							KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten
					KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 49 Abs. 2 SolV)	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge		Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen, Inkongruenzenbereinigte Beträge	Substitutionseffekte			
				(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden		Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode		Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge		
					04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10		11=04+09+10
010	Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position													
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV												
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV												
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV												
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV												
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten													
070	0%												
080	10%												
090	20%												
100	35%												
110	50%												
120	darunter: Überfällige Positionen												
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur												
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen												
145	70%												
150	75%												
160	100%												
170	darunter: Überfällige Positionen												
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur												
190	Durch Immobilien besicherte Positionen												
200	150%												
210	darunter: Überfällige Positionen												
220	200%												
230	Sonstige Risikogewichte												

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**47. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q12  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse: **Beteiligungen**      Institutsnummer:       Prüzfiffer:       Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:       Stand Ende:       Sachbearbeiter/in:       Telefon:

in Mio Euro

	Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
	Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente		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
010	Gesamtsumme										Übertrag UB Meldebogen
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV  Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen  Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV  Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV  Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV										
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten											
070	0%										
080	10%										
090	20%										
100	35%										
110	50%										
120	darunter: Überfällige Positionen										
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen										
145	70%										
150	75%										
160	100%										
170	darunter: Überfällige Positionen										
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
190	Durch Immobilien besicherte Positionen										
200	150%										
210	darunter: Überfällige Positionen										
220	200%										
230	Sonstige Risikogewichte										



**48. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q13  
Blatt 1**

KSA-Forderungsklasse:       Institutsnummer:       Prüzfiffer:       Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe:       Stand Ende:       Sachbearbeiter/in:       Telefon:

Finanzholding-Gruppe:

in Mio Euro

KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten																		
Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekte bei den KSA-Bemessungsgrundlagen																		
Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge					Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge		Substitutionseffekte									
					Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode				(-) Gesamtsumme der Abgänge		Gesamtsumme der Zugänge							
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Rückstellungen (§ 49 Abs. 2 SolV)					Garantien		Kreditderivate		07		08		09 = 05+06+07+08		10		11=04+09+10	
(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden					01		02		03		04=01+03							
darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktwertbemessungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)																		
KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Rückstellungen (§ 49 Abs. 2 SolV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen					01		02		03		04=01+03							
Gesamtsumme																		
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position																		
Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV																		
Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																		
Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV																		
Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV																		
Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV																		
Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten																		
0%																		
10%																		
20%																		
35%																		
50%																		
darunter: Überfällige Positionen																		
Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur																		
Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen																		
70%																		
75%																		
100%																		
darunter: Überfällige Positionen																		
Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur																		
Durch Immobilien besicherte Positionen																		
150%																		
darunter: Überfällige Positionen																		
200%																		
Sonstige Risikogewichte																		

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**48. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q13  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse: sonstige Positionen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

	Kreditrisikominderungsstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschwindungsrisikofaktor (FIE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(+/-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsrisikofaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsrisikofaktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungsstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
						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	
010 <b>Gesamtsumme</b>												Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>												
020 <b>Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV</b>												
030 <b>Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen</b>												
040 <b>Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV</b>												
050 <b>Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV</b>												
060 <b>Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV</b>												
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>												
070 <b>0%</b>												
080 <b>10%</b>												
090 <b>20%</b>												
100 <b>35%</b>												
110 <b>50%</b>												
120 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
130 <b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>												
140 <b>Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen</b>												
145 <b>70%</b>												
150 <b>75%</b>												
160 <b>100%</b>												
170 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
180 <b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>												
190 <b>Durch Immobilien besicherte Positionen</b>												
200 <b>150%</b>												
210 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
220 <b>200%</b>												
230 <b>Sonstige Risikogewichte</b>												

**49. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q14  
Blatt 1**

<b>KSA-Forderungsklasse:</b>	<b>überfällige Positionen</b>	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

						Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den KSA-Bemessungsgrundlagen					KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
						Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge		Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen, Inkongruenzenbereinigte Beträge	Substitutionseffekte		
						Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode		(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	
						05	06	07	08	09 = 05+06+07+08	10	
010												
	Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030		Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen										
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
	Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten											
070	0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

**49. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA Q14  
Blatt 2**

KSA-Forderungsklasse: **überfällige Positionen**

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

	Kreditrisikominderungsstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode	Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Verschwindungsrisikofaktor (FIE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(+/-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsrisikofaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsrisikofaktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungsstechniken	Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV				KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
						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
010 <b>Gesamtsumme</b>												Übertrag UB Meldebogen
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position</b>												
020 <b>Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV</b>												
030 <b>Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen</b>												
040 <b>Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV</b>												
050 <b>Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV</b>												
060 <b>Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV</b>												
<b>Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten</b>												
070 <b>0%</b>												
080 <b>10%</b>												
090 <b>20%</b>												
100 <b>35%</b>												
110 <b>50%</b>												
120 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
130 <b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>												
140 <b>Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen</b>												
145 <b>70%</b>												
150 <b>75%</b>												
160 <b>100%</b>												
170 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
180 <b>Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur</b>												
190 <b>Durch Immobilien besicherte Positionen</b>												
200 <b>150%</b>												
210 <b>darunter: Überfällige Positionen</b>												
220 <b>200%</b>												
230 <b>Sonstige Risikogewichte</b>												

**50. Meldung über KSA-Positionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA QV  
Blatt 1**

<b>KSA-Forderungskategorie:</b>	<b>Verbriefungen</b>	Institutsnummer:	Prüf- ziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:
<b>Verbriefungsart:</b>	<b>Summenblatt</b>			
<b>Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:</b>		Stand Ende:	Sachbearbeiter/in:	Telefon:

in Mio Euro

Anlage 10														
		Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositionen	Synthetische Verbriefung: Auf das verbrieft Portfolio angewandte Kreditrisikominderungs-techniken				Verbriefungs- positionen	(-) Werberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (5) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 238 S.4 VV)	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten auf die KSA-Bemessungsgrundlage				
			(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsbereinigte Beträge (a)	(-) Abgänge insgesamt	Um Währungsinkongruenzen bereinigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Nominalbetrag zurückgehaltener oder zurückgeworbener Kreditbesicherung				KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken und zzgl. Werberichtigungen und Rückstellungen	Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten sowie als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzbereinigte Beträge	Substitutionseffekte durch Anwendung von Kreditrisikominderungs-techniken auf die KSA-Bemessungsgrundlage	
													(-) Abgänge insgesamt	Zufüsse insgesamt
		01	02	03	04	05	06	07=05+06	08	09	10	11		
010	<b>Gesamtsumme</b>													
011	darunter: Wiederverbriefungspositionen													
020	<b>Originator: Gesamtengagement</b>													
030	Bilanzielle Adressenausfall-risikopositionen													
031	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen													
032	Wiederverbriefungspositionen													
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen													
071	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen													
072	Wiederverbriefungspositionen													
080	Vorzeitige Tilgung													
090	<b>Investor: Gesamtengagement</b>													
091	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWVG ist													
100	Bilanzielle Adressenausfall-risikopositionen													
101	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen													
102	Wiederverbriefungspositionen													
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen													
141	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen													
142	Wiederverbriefungspositionen													
150	<b>Sponsor: Gesamtengagement</b>													
160	Bilanzielle Adressenausfall-risikopositionen													
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen													

(a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche

**50. Meldung über KSA-Positionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA QV**

Blatt 2

**KSA-Forderungsklasse:**

**Verbriefungsart:**

**Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:**

<b>Verbriefungen</b>
<b>Summenblatt</b>

Instituts-  
nummer:

Prüf-  
ziffer:

Übergeordnetes  
Unternehmen:

Stand  
Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

		KSA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungsstechniken	Aufgliederung der KSA-Bemessungsgrundlage aus Spalte (14) von außerbilanziellen Positionen nach KSA-Konversionsfaktoren				KSA-Positions-wert (§ 239 SolvV)	KSA-Positions-wert nach Eigenkapitalabzugspositionen (-) Abzug vom Eigenkapital (§ 267 SolvV)		
				0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%				
		12 = 07+10+11	13	14	15	16	17	18	19	20	21=19+20
010	Gesamtsumme										
011	darunter: Wiederverbriefungspositionen										
020	Originator: Gesamtengagement										
030	Bilanzielle Adressenausfall-risikopositionen										
031	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen										
032	Wiederverbriefungspositionen										
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen										
071	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen										
072	Wiederverbriefungspositionen										
080	Vorzeitige Tilgung										
090	Investor: Gesamtengagement										
091	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist										
100	Bilanzielle Adressenausfall-risikopositionen										
101	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen										
102	Wiederverbriefungspositionen										
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen										
141	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen										
142	Wiederverbriefungspositionen										
150	Sponsor: Gesamtengagement										
160	Bilanzielle Adressenausfall-risikopositionen										
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen										

**50. Meldung über KSA-Positionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**KSA QV  
Blatt 3**

KSA-Forderungsklasse:

Verbriefungsart:

Institutsgruppe /  
Finanzholding-Gruppe:

Verbriefungen
Summenblatt

Instituts-  
nummer:

Prüf-  
ziffer:

Übergeordnetes  
Unternehmen:

Stand:

Ende:

Sach-  
bearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

		Aufgliederung der KSA-Positionswerte nach Risikogewichten											Risikogewichteter KSA-Positionswert ( § 240 SolV)	Zuschlag zum risikogewichteten KSA-Positionswert (§ 240 SolV) bei Verstoß gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)	Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten KSA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeiterückdeckung bei synthetischen Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	Nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von KSA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Aggregierte Kapitalanforderungen
		Mit Rating (Bonitätsstufe 1 bis 4)							1250%		Durchschau							
		20%	40%	50%	100%	225%	350%	650%	mit Rating	ohne Rating	darunter: Zweifelrisikopositionen in ABCP							
											28	29						
30	34	35	31	32	33													
010	Gesamtsumme																	Übertrag ÜB Meldebogen
011	darunter: Wiederverbriefungspositionen																	Übertrag ÜB Meldebogen
020	Originator: Gesamtengagement																	
030	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																	
031	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																	
032	Wiederverbriefungspositionen																	
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																	
071	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																	
072	Wiederverbriefungspositionen																	
080	Vorzeitige Tilgung																	
090	Investor: Gesamtengagement																	
091	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																	
100	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																	
101	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																	
102	Wiederverbriefungspositionen																	
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																	
141	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																	
142	Wiederverbriefungspositionen																	
150	Sponsor: Gesamtengagement																	
160	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																	
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																	

51. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QS

IRBA-Forderungsklasse:	Summenblatt (Anlage 3 Nr. 52, 53, 54, 55)	Institutsnummer:	Prüfziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja	Stand Ende:	Sachbearbeiter/in:	Telefon:
Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:				

in Mio Euro

		IRBA-Positionenwert nach § 99 SolV		darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten		darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen		IRBA-Positionenwert nach § 99 SolV										
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12											
														Internes Ratingssystem	Einem Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 100 SolV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktwertbewertungsmethode, SM oder ILM berechnet (b)	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien	Substitutionseffekte	Gesamtsumme der Zugänge	(c) Gesamtsumme der Abgänge
1. Gesamtsumme																								
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																								
1020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV																							
1030	Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																							
1040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV																							
1050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV																							
1060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV																							
1070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																							
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																								
1080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1																							
1090	2																							
1100	3																							
1110	4																							
1120	5																							
1130	6																							
1140	7																							
1150	8																							
1160	9																							
1170	10																							
1180	11																							
1190	12																							
1200	13																							
1210	14																							
1220	15																							
1230	16																							
1240	17																							
1250	18																							
1260	19																							
1270	20																							

Blatt 1

Blatt 1



## 51. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QS

<b>IRBA-Forderungsklasse:</b>	Summenblatt (Anlage 3 Nr. 52, 53, 54, 55)	Institutsnummer:	Prüfziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			
Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:		Stand Ende:	Sachbearbeiter/in:	Telefon:

in Mio Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außenfinanziale Adressenausfallrisikopositionen			
				Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Kreditderivate	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche	Substitutionseffekte		darunter: Außenfinanziale Adressenausfallrisikopositionen						
							Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge							
													01	02	03
280	21														
290	22														
300	23														
310	24														
320	25														
330	26														
340	27														
350	28														
360	29														
370	30														
380	31														
390	32														
400	33														
410	34														
420	35														
430	36														
440	37														
450	38														
460	39														
470	40														
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme														
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden														
490	0%														
500	50%														
510	70%														
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren														
530	90%														
540	115%														
550	250%														
560	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden														
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird														
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen														

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolvV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden Blatt 2

## 51. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QS

IRBA-Forderungsklasse:	Summenblatt (Anlage § Nr. 52, 53, 54, 55)	Institutsnummer:	Prüfziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja			
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:	Stand Ende:	Sachbearbeiter/in:	Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichte durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 64 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten				Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolV)						(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer	
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten		Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten						
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB-Meldebogen			
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV															
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitenansprüchen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV															
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV															
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV															
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme															
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1															
090	2															
100	3															
110	4															
120	5															
130	6															
140	7															
150	8															
160	9															
170	10															
180	11															
190	12															
200	13															
210	14															
220	15															
230	16															
240	17															
250	18															
260	19															
270	20															

Blatt 3

## 51. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QS

IRBA-Forderungsklasse:	Summenblatt (Anlage 3 Nr. 52, 53, 54, 55)	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

in Mio EUR

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)								Double Default Effekte	Positionswertgewichte durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten												Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
			Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten										
							Grundpfandrechte IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten								
280	21	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	
290	22																
300	23																
310	24																
320	25																
330	26																
340	27																
350	28																
360	29																
370	30																
380	31																
390	32																
400	33																
410	34																
420	35																
430	36																
440	37																
450	38																
460	39																
470	40																
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme																
490	0%																
500	50%																
510	70%																
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren																
530	90%																
540	115%																
550	250%																
560	1.3 Grundpfandrechte besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden																
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird																
580	1.5 Verfallsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen																

#### 51a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QSa

<b>IRBA-Forderungsklasse:</b>		<b>Summenblatt</b> (Anlage 3 Nr. 52a, 53a, 55a)	Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>	Übergeordnetes Unternehmen:	<input type="text"/>
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:		Nein						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		<input type="text"/>	Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>	Telefon:	<input type="text"/>

in Mio Euro

		Interne Rating/stern	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IPBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	IPBA-Bemessungswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
				darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	Substitutionseffekte	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche	Gesamtsumme der Zugänge					(-) Gesamtsumme der Abgänge
01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12			
101	1. Gesamtsumme													
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position														
102	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV													
103	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen													
104	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV													
105	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV													
106	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV													
107	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme													
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind														
108	Ratingstufe oder Risikopool (a):1													
109	2													
110	3													
111	4													
112	5													
113	6													
114	7													
115	8													
116	9													
117	10													
118	11													
119	12													
120	13													
121	14													
122	15													
123	16													
124	17													
125	18													
126	19													
127	20													

## 51a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QSa

IRBA-Forderungsklasse:	Summenblatt (Anlage 3 Nr. 52a, 53a, 55a)	Institutsnummer:	Prüfziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein			
Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:		Stand Ende:	Sachbearbeiter/in:	Telefon:

in Mio Euro

in Mio EUR

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen					IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten		IRBA-Positionenwert nach § 99 SolV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen		
				Einmalige Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	09=02+07+08	10	11	12					
										Substitutionseffekte			Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge
		01	02	03	04	05	06	07	08					
280	21													
290	22													
300	23													
310	24													
320	25													
330	26													
340	27													
350	28													
360	29													
370	30													
380	31													
390	32													
400	33													
410	34													
420	35													
430	36													
440	37													
450	38													
460	39													
470	40													
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme													
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden												
490	0%													
500	50%													
510	70%													
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren													
530	90%													
540	115%													
550	250%													
560	1.3 Grundpfandrechtl. besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden													
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird													
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen													

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden  
Blatt 2

## 51a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QSa

IRBA-Forderungsklasse:	Summenblatt (Anlage 3 Nr. 52a, 53a, 55a)	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichte durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolV)	(-) Verbriefungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
Grundpfandrechte IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sachschulden	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten														
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB-Meldebogen			
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV															
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV															
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV															
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV															
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme															
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1															
090	2															
100	3															
110	4															
120	5															
130	6															
140	7															
150	8															
160	9															
170	10															
180	11															
190	12															
200	13															
210	14															
220	15															
230	16															
240	17															
250	18															
260	19															
270	20															

Blatt 2

Blatt 3

## 51a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QSa

IRBA-Forderungsklasse:	Summenblatt (Anlage 3 Nr. 52a, 53a, 55a)	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungsstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben					
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten										Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer			
Garantien		Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Berücksichtigungsfähige sonstige Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten			Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten von Forderungen	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sachanlagen	Grundpfandrechte IRBA-Sachenheiten	20	21	22	23	24	25	26	27	
13	14				15	16	17												18
280	21																		
290	22																		
300	23																		
310	24																		
320	25																		
330	26																		
340	27																		
350	28																		
360	29																		
370	30																		
380	31																		
390	32																		
400	33																		
410	34																		
420	35																		
430	36																		
440	37																		
450	38																		
460	39																		
470	40																		
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme																		
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden																	
490	0%																		
500	50%																		
510	70%																		
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren																		
530	90%																		
540	115%																		
550	250%																		
560	1.3 Grundpfandrechte besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden																		
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird																		
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen																		

Blatt 4

## 52. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q1

IRBA-Forderungsklasse: Zentralregierungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Ja

Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekte bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen					IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	IRBA-Positionen nach § 99 SolV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
				darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktwertbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte	Gesamtsumme der Zugänge				(-) Gesamtsumme der Abgänge
01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12	
010	1. Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position												
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV											
030	Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV											
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV											
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind												
080	Ratingstufe oder Risikopool (a):1											
090	2											
100	3											
110	4											
120	5											
130	6											
140	7											
150	8											
160	9											
170	10											
180	11											
190	12											
200	13											
210	14											
220	15											
230	16											
240	17											
250	18											
260	19											
270	20											

Blatt 1



## 52. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q1

<b>IRBA-Forderungskategorie:</b>	Zentralregierungen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
<b>Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:</b>	Ja						
<b>Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:</b>		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro												
	IRBA-Positionen nach § 99 SolV		darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
	Interne Ratingsystem	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen		Substitutionseffekte	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Krediterlöse	Kreditderivate	Garantien				
									01			02
		Einer Ratingstufe oder einem Risikograd zugeordnete proportionale Ausfallwahrscheinlichkeit (%)										
280	21									09=02+07+08	10	11
290	22											
300	23											
310	24											
320	25											
330	26											
340	27											
350	28											
360	29											
370	30											
380	31											
390	32											
400	33											
410	34											
420	35											
430	36											
440	37											
450	38											
460	39											
470	40											
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme											
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden										
490	0%											
500	50%											
510	70%											
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren											
530	90%											
540	115%											
550	250%											
560	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden											
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird											
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen											

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 52. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q1

IRBA-Forderungsklasse:	Zentralregierungen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionengewichte durchschnitliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionengewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
			Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten													
			Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grund/andere IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten								
13	14	15							16	17	18	19	20	21	22	23
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB-Meldebogen			
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV															
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV															
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV															
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV															
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme															
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1															
090	2															
100	3															
110	4															
120	5															
130	6															
140	7															
150	8															
160	9															
170	10															
180	11															
190	12															
200	13															
210	14															
220	15															
230	16															
240	17															
250	18															
260	19															
270	20															

Blatt 3

## 52. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q1

IRBA-Forderungsklasse: Zentralregierungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Ja

Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Doppelte Default Effekte	Nachrichtliche Angaben							
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten					Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer	
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten			20	21	22	23	24	25	26	27	
13	14	15	16	17	18	19											
280	21																
290	22																
300	23																
310	24																
320	25																
330	26																
340	27																
350	28																
360	29																
370	30																
380	31																
390	32																
400	33																
410	34																
420	35																
430	36																
440	37																
450	38																
460	39																
470	40																
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme																
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden															
490	0%																
500	50%																
510	70%																
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren																
530	90%																
540	115%																
550	250%																
560	1.3 Grundpfandrechtl. besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden																
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird																
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen																

## 52a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q1a

IRBA-Forderungsklasse: Zentralregierungen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Nein

Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

in Mio Euro														
	Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen								IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionen nach § 99 SolV		
			Einem Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete proportionierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	darunter: nach der Laufzeitmethode Marktwertermittlungsmethode, SM oder IMM berechnete (b)	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Kreditderivate		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte			darunter: Aufbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen		
					Kreditderivate	Garantien			Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge			10	
	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12		
101	1. Gesamtsumme													
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position														
102	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV													
103	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen													
104	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV													
105	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV													
106	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV													
107	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme													
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind														
108	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1													
109	2													
110	3													
111	4													
112	5													
113	6													
114	7													
115	8													
116	9													
117	10													
118	11													
119	12													
120	13													
121	14													
122	15													
123	16													
124	17													
125	18													
126	19													
127	20													

Blatt 1

Blatt 1

## 52a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q1a

IRBA-Forderungsklasse:	Zentralregierungen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten		IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	darunter: Aufgeblanzte Adressenausfallrisikopositionen
				Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche	Substitutionseffekte	Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge				
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugewordene prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)		darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12
280	21		02	03									
290	22												
300	23												
310	24												
320	25												
330	26												
340	27												
350	28												
360	29												
370	30												
380	31												
390	32												
400	33												
410	34												
420	35												
430	36												
440	37												
450	38												
460	39												
470	40												
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden											
490	0%												
500	50%												
510	70%												
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
530	90%												
540	115%												
550	250%												
560	1.3 Grundpfandrechtl. besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden												
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird												
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen												

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 52a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q1a

IRBA-Forderungsklasse:	Zentralregierungen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichte durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 94 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben			
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer	
			Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten										
							Grundarchitekturelle IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten									Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherstellung von Forderungen
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB-Meldebogen				
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																	
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV																
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV																
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV																
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV																
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																	
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1																
090	2																
100	3																
110	4																
120	5																
130	6																
140	7																
150	8																
160	9																
170	10																
180	11																
190	12																
200	13																
210	14																
220	15																
230	16																
240	17																
250	18																
260	19																
270	20																

Blatt 3

## 52a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q1a

IRBA-Forderungskategorie:	Zentralregierungen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionenwertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionenwertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionenwert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben			
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolvV)	Anzahl der Kreditnehmer	
			Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten										
							Grundpfandrechte IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten									Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherungsabtretung von Forderungen
13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27			
280	21																
290	22																
300	23																
310	24																
320	25																
330	26																
340	27																
350	28																
360	29																
370	30																
380	31																
390	32																
400	33																
410	34																
420	35																
430	36																
440	37																
450	38																
460	39																
470	40																
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme																
			Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden														
490	0%																
500	50%																
510	70%																
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren																
530	90%																
540	115%																
550	250%																
560	1.3 Grundpfandrechte besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden																
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird																
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen																

### 53. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q2

<b>IRBA-Forderungsklasse:</b>		<b>Institute</b>	Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>	Übergeordnetes Unternehmen:	<input type="text"/>
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:		<b>Ja</b>						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		<input type="text"/>	Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>	Telefon:	<input type="text"/>

[illegible]



## 53. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q2

IRBA-Forderungsklasse:		Institute		Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:		Ja		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:									

  

in Mio Euro												
	Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten		IRBA-Positionen nach § 99 SolV	
			Einem Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnete (b)	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche	Substitutionseffekte		darunter: Aufrechnerische Adressenausfallrisikopositionen		
								(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge			
	01	02	03	04	05	06	07	08	09-02+07+08	10	11	12
280	21											
290	22											
300	23											
310	24											
320	25											
330	26											
340	27											
350	28											
360	29											
370	30											
380	31											
390	32											
400	33											
410	34											
420	35											
430	36											
440	37											
450	38											
460	39											
470	40											
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme											
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden											
490	0%											
500	50%											
510	70%											
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren											
530	90%											
540	115%											
550	250%											
560	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden											
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird											
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen											

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 53. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q2

IRBA-Forderungsklasse:	Institute	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja						
Institutgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionengewichte durchschnitliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionengewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolV)	(+) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
			Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten													
			Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundarchitektonische IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten Sachanlagen								
13	14	15							16	17	18	19	20	21	22	23
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB-Meldbogen			
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV															
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV															
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV															
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV															
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme															
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1															
090	2															
100	3															
110	4															
120	5															
130	6															
140	7															
150	8															
160	9															
170	10															
180	11															
190	12															
200	13															
210	14															
220	15															
230	16															
240	17															
250	18															
260	19															
270	20															

Blatt 3

## 53. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q2

IRBA-Forderungsklasse:	Institute	Institutsnummer:	Prüfziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja			
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:	Sachbearbeiter/in:	Telefon:

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolV)	Anzahl der Kreditnehmer
Grundpfandrehtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sachversicherungen	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherungsabtretung von Forderungen														
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280	21															
290	22															
300	23															
310	24															
320	25															
330	26															
340	27															
350	28															
360	29															
370	30															
380	31															
390	32															
400	33															
410	34															
420	35															
430	36															
440	37															
450	38															
460	39															
470	40															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden														
490	0%															
500	50%															
510	70%															
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren															
530	90%															
540	115%															
550	250%															
560	1.3 Grundpfandrehtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden															
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

## 53a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q2a

IRBA-Forderungsklasse:		Institute	Institutsnummer:		Prüfziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:		Nein					
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:	Sachbearbeiter/in:	Telefon:		

in Mio Euro

	Interne Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionen nach § 99 SolvV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	
			Einem Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	darunter: nach der Laufzeimethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte				
01	02	03						04	05	06	(-) Gesamtsumme der Zugänge	Gesamtsumme der Zugänge
101	1. Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position												
102	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
103	Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
104	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
105	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
106	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
107	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme											
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind												
108	Ratingstufe oder Risikopool (a):1											
109	2											
110	3											
111	4											
112	5											
113	6											
114	7											
115	8											
116	9											
117	10											
118	11											
119	12											
120	13											
121	14											
122	15											
123	16											
124	17											
125	18											
126	19											
127	20											

Blatt 1

## 53a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q2a

IRBA-Forderungsklasse:

Institute

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Nein

Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

in Mio Euro																									
	IRBA-Positionswert nach § 99 SolV	darunter: Außenherzielte Adressenausfallrisikopositionen	12	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikomodifizierungstechniken mit Substitutionseffekten	09=02+07+08	08	Gesamtsumme der Zugänge	07	(-) Gesamtsumme der Abgänge	06	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	05	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Kreditrisikomodifizierungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen			04	Garantien	03	darunter: nach der Laufzeitmethode Marktwertermittlungsmethode, SM oder ILM berechnete (b)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikomodifizierungstechniken (§ 100 SolV)	02	Internes Ratingssystem	01	Einer Ratingstufe oder einem Risikoprofil zugeordnetem prozentualen Ausfallwahrscheinlichkeit (%)
														21	22	23									
280																									
290																									
300																									
310																									
320																									
330																									
340																									
350																									
360																									
370																									
380																									
390																									
400																									
410																									
420																									
430																									
440																									
450																									
460																									
470																									
480																									
490																									
500																									
510																									
520																									
530																									
540																									
550																									
560																									
570																									
580																									

## 53a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q2a

IRBA-Forderungsklasse:	Institute	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)															Nachrichtliche Angaben					
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten					Berücksichtigungsfähige Garantien	Positionswertgewichte durchschnitlich prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Postorswertgewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risiko-gewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verluste bei IRBA (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer						
Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	20	21	22	23	24	25	26	27								
13	14	15	16	17	18	19																
010	1. Gesamtsumme																			Übertrag ÜB-Meldebogen		
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																				
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV																					
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																					
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV																					
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV																					
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV																					
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																					
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																				
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1																					
090	2																					
100	3																					
110	4																					
120	5																					
130	6																					
140	7																					
150	8																					
160	9																					
170	10																					
180	11																					
190	12																					
200	13																					
210	14																					
220	15																					
230	16																					
240	17																					
250	18																					
260	19																					
270	20																					

Bilanz

Blatt 3



## 54. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q3

IRBA-Forderungsklasse: Mengengeschäft

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes Unternehmen:

Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Ja

Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Sachbearbeiter/in:

Telefon:

in Mio Euro

		Interne Ratingstufen	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsmaßnahmen (§ 100 SolvV)	Kreditrisikominderungsmaßnahmen mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsmaßnahmen mit Substitutionseffekten		IRBA-Positionen nach § 99 SolvV			
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktwertminderungsansatz, SM oder IMM berechnet (b)	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte	Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen		
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07+08	10	11	12
101	1. Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position													
102	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
103	Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen												
104	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
105	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
106	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
107	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind													
108	Ratingstufe oder Risikopool (a):1												
109	2												
110	3												
111	4												
112	5												
113	6												
114	7												
115	8												
116	9												
117	10												
118	11												
119	12												
120	13												
121	14												
122	15												
123	16												
124	17												
125	18												
126	19												
127	20												

Blatt 1



54. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q3

IRBA-Forderungsklasse:	Mengengeschäft	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro																	
		Internes Ratingsystem	Einzel Ratingstufe oder einem Risikokod zugewordnete prozentualisierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	01	02	03	Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen				IRBA-Bemessungsgrundlage nach § 99 SolV		12				
							darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Kreditderivate	Kreditderivate	Garantien	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche	Substitutionseffekte		Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	09=02+07+08	10
280	21																
290	22																
300	23																
310	24																
320	25																
330	26																
340	27																
350	28																
360	29																
370	30																
380	31																
390	32																
400	33																
410	34																
420	35																
430	36																
440	37																
450	38																
460	39																
470	40																
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme																
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden																
490	0%																
500	50%																
510	70%																
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren																
530	90%																
540	115%																
550	250%																
560	1.3 Grundpfandrehtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden																
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird																
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen																

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit  
 (b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden  
 Blatt 2

## 54. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q3

IRBA-Forderungsklasse:	Mengengeschäft	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichte durchschnittlich bei Ausfall (%)	Postfaktorswertgewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten					Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					Erwarteter Verlustbeitrag (§ 104 SolV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sachschulden	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherungsabtretung von Forderungen								
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB-Meldebogen			
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV															
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV															
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV															
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV															
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme															
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1															
090	2															
100	3															
110	4															
120	5															
130	6															
140	7															
150	8															
160	9															
170	10															
180	11															
190	12															
200	13															
210	14															
220	15															
230	16															
240	17															
250	18															
260	19															
270	20															

Bilanz

Blatt 3

54. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q3

IRBA-Forderungsklasse:	Mengengeschäft	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro																
		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionenwertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionenwertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Positionenwertgewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten				Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Ewartete Verlustbeträge (§ 104 SolV)					(-) Werberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer	
																Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten
Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten													
				13	14	15	16	17	18	19						
280	21								20	21	22	23	24	25	26	27
	22															
	23															
	24															
	25															
	26															
	27															
	28															
	29															
	30															
	31															
	32															
	33															
	34															
	35															
	36															
	37															
	38															
	39															
	40															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden														
490	0%															
500	50%															
510	70%															
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren															
530	90%															
540	115%															
550	250%															
560	1.3 Grundpfandrechte besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden															
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

## 55. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q4

IRBA-Forderungsklasse:	Unternehmen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 100 SolvV)	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionen nach § 99 SolvV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
	Interne Ratingssystem	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte	
	Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktwertbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Kreditderivate	Gesamtsumme der Zugänge	
	01	02	03	04	05
010 1. Gesamtsumme					
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position					
020 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV					
030 Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen					
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV					
050 Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV					
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV					
070 1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme					
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind					
080 Ratingstufe oder Risikopool (a):1					
090 2					
100 3					
110 4					
120 5					
130 6					
140 7					
150 8					
160 9					
170 10					
180 11					
190 12					
200 13					
210 14					
220 15					
230 16					
240 17					
250 18					
260 19					
270 20					

Blatt 1

55. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q4

IRBA-Forderungsklasse:	Unternehmen	Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>	Übergeordnetes Unternehmen:	<input type="text"/>
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:	<input type="text"/>	Sachbearbeiter/in:	<input type="text"/>	Telefon:	<input type="text"/>

in Mio Euro											
		IRBA-Positionen nach § 99 SolV									
		darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen									
		darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen									
		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten									
Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekte bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
Substitutionseffekte										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Kreditderivate										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktwertermittlungsmethode, SM oder ILM berechnet (b)										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten (§ 100 SolV)										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
Interne Ratingsystem										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
Einige Ratingsysteme oder andere Risikogewicht zugewordene prozentuale Ausfallwahrscheinlichkeit (%)										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
01										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
02										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
03										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
04										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
05										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
06										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
07										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
08										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
09=02+07+08										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
10										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
11										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
12										IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- und Substitutionseffekten	
280	21										
290	22										
300	23										
310	24										
320	25										
330	26										
340	27										
350	28										
360	29										
370	30										
380	31										
390	32										
400	33										
410	34										
420	35										
430	36										
440	37										
450	38										
460	39										
470	40										
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme										
490	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden										
500	0%										
510	50%										
520	70%										
530	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren										
540	90%										
550	115%										
560	250%										
570	1.3 Grundpfandrehtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden										
580	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird										
590	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen										

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 55. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q4

IRBA-Forderungskategorie:	Unternehmen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionenwertgewichte durchschnitlich prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionenwertgewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolV)	(+) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
			Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten									
							Grundandienliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten								
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB-Meldebogen			
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position																
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolV															
030	Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolV															
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolV															
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolV															
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme															
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind																
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1															
090	2															
100	3															
110	4															
120	5															
130	6															
140	7															
150	8															
160	9															
170	10															
180	11															
190	12															
200	13															
210	14															
220	15															
230	16															
240	17															
250	18															
260	19															
270	20															

Blatt 3

Blatt 3

55. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q4

IRBA-Forderungsklasse:	Unternehmen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Ja						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro																
		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionenwertgewichte durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionenwertgewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten					Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					Anzahl der Kreditnehmer	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)
Grundpfandrechte IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten von Forderungen														
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280		21														
290		22														
300		23														
310		24														
320		25														
330		26														
340		27														
350		28														
360		29														
370		30														
380		31														
390		32														
400		33														
410		34														
420		35														
430		36														
440		37														
450		38														
460		39														
470		40														
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
	Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolvV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden															
490	0%															
500	50%															
510	70%															
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren															
530	90%															
540	115%															
550	250%															
560	1.3 Grundpfandrechlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden															
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

## 55a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q4a

IRBA-Forderungsklasse:	Unternehmen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

	IRBA-Bewertungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 100 SolvV)	IRBA-Bewertungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bewertungsgrundlagen	IRBA-Bewertungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionen nach § 99 SolvV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
Interne Ratingssystem	Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte	Gesamtsumme der Zugänge
01	02	03	04	05	06
07	08	09=02+07+08	10	11	12
1. Gesamtsumme					
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position					
020	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV				
030	Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen				
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV				
050	Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV				
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV				
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme				
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind					
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1				
090	2				
100	3				
110	4				
120	5				
130	6				
140	7				
150	8				
160	9				
170	10				
180	11				
190	12				
200	13				
210	14				
220	15				
230	16				
240	17				
250	18				
260	19				
270	20				

Blatt 1



## 55a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q4a

IRBA-Forderungsklasse:	Unternehmen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

in Mio Euro

		Internes Ratingssystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken (§ 100 SolV)	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen						IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs-techniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Positionenwert nach § 99 SolV	darunter: Außenblanzteile Adressenausfallrisikopositionen			
				darunter: Außenblanzteile Adressenausfallrisikopositionen	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutionseffekte		Gesamtsumme der Zugänge				(-) Gesamtsumme der Abgänge		
							Kreditderivate	Garantien						Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prozentuale Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)							09=02+07+08	10	11	12		
280	21														
290	22														
300	23														
310	24														
320	25														
330	26														
340	27														
350	28														
360	29														
370	30														
380	31														
390	32														
400	33														
410	34														
420	35														
430	36														
440	37														
450	38														
460	39														
470	40														
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme														
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden													
490	0%														
500	50%														
510	70%														
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren														
530	90%														
540	115%														
550	250%														
560	1.3 Grundpfandrehtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden														
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird														
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen														

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe bzw. Risikopool jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe oder dem Risikopool mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit

(b) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

Blatt 2

## 55a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q4a

IRBA-Forderungsklasse:	Unternehmen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
Institutgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionengewichte durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionengewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben			
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten					Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolvV)					(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer		
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten						Übertrag ÜB-Meldebogen					
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	
010 1. Gesamtsumme													Übertrag ÜB-Meldebogen				
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position															
020 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV																	
030 Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																	
040 Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheiten nachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV																	
050 Derivative Adressenausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV																	
060 Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV																	
070 1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme																	
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind															
080 Ratingstufe oder Ratingpool (a):1																	
090 2																	
100 3																	
110 4																	
120 5																	
130 6																	
140 7																	
150 8																	
160 9																	
170 10																	
180 11																	
190 12																	
200 13																	
210 14																	
220 15																	
230 16																	
240 17																	
250 18																	
260 19																	
270 20																	

Blatt 3

## 55a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA Q4a

IRBA-Forderungskategorie:	Unternehmen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:	
Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	Nein						
Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:		Telefon:	

in Mio Euro

		Kreditrisikominderungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)							Double Default Effekte	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Postionswert (§ 84 SolV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Berücksichtigungsfähige Sicherheiten						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen					Erwartete Verlustbeiträge (§ 104 SolV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
Grundpfandrechte IRBA-Sicherheiten																
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280	21															
290	22															
300	23															
310	24															
320	25															
330	26															
340	27															
350	28															
360	29															
370	30															
380	31															
390	32															
400	33															
410	34															
420	35															
430	36															
440	37															
450	38															
460	39															
470	40															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die Spezialfinanzierungen sind und nach § 97 SolV mit dem einfachen Risikogewicht berücksichtigt werden														
490	0%															
500	50%															
510	70%															
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren															
530	90%															
540	115%															
550	250%															
560	1.3 Grundpfandrechtl. besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden															
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Risikogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

56. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QN

IRBA-Forderungsklasse:

nachrichtliche Angaben zu einzelnen Unterklassen von IRBA-Forderungsklassen

Institutsnummer:

Prüfziffer:

99901	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:	
-------	--	--

Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

in Mio Euro

	IRBA-Positionenwert nach § 99 SolV	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	darunter: Außenbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten	Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen								
					Gesamtsumme der Zugänge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate					
								Kreditderivate	Garantien				
										darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 100 SolV)		
09=02+07+08	10	11	12	01	02	03	04	05	06			07	08
Forderungsklasse Institute darunter: Kreditinstitute und Wertpapierhandelsunternehmen													
010	Gesamtsumme												
Forderungsklasse Unternehmen darunter: Spezialfinanzierungen													
020	Gesamtsumme												
Forderungsklasse Unternehmen: darunter: Kleine und mittlere Unternehmen													
030	Gesamtsumme												
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Durch Immobilien besichert													
040	Gesamtsumme												
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Qualifiziertes revolvingendes Mengengeschäft													
050	Gesamtsumme												
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Kleine und mittlere Unternehmen													
060	Gesamtsumme												

(a) einschließlich Aufrechnungspositionen nach § 12 SolV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden  
Blatt 1

IRBA-Forderungsklasse:

nachrichtliche Angaben zu einzelnen Unterklassen von IRBA-Forderungsklassen

99901

Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversionsfaktoren:

Übergeordnetes Unternehmen:

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

IRBA QN

in Mio Euro

		Kreditrisikominierungstechniken, die sich auf die prognostizierte Verlustquote bei Ausfall auswirken (ohne Double Default Effekte)															Double Default Effekte		Positionenvergewichte durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionenvergewichte durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Nachrichtliche Angaben		
		Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditterivate		Berücksichtigungsfähige Sicherheiten					Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen		Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer												
														Garantien	Kreditterivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Sonstige berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten					Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherheiten	20
13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27											
Forderungsklasse Institute darunter: Kreditinstitute und Wertpapierhandelsunternehmen																									
010	Gesamtsumme																								
Forderungsklasse Unternehmen darunter: Spezialfinanzierungen																									
020	Gesamtsumme																								
Forderungsklasse Unternehmen: darunter: Kleine und mittlere Unternehmen																									
030	Gesamtsumme																								
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Durch Immobilien besichert																									
040	Gesamtsumme																								
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Qualifiziertes revolvingendes Mengengeschäft																									
050	Gesamtsumme																								
Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Kleine und mittlere Unternehmen																									
060	Gesamtsumme																								

## IRBA QB

## nd

Blatt 1

## IRBA QB

## Stand

1

[illegible]

(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit.

**58. Meldung über IRBA-Positionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**IRBA QV**

**IRBA-Forderungs-  
klasse:**

**Verbriefungsart:**

<b>Verbriefungen</b>
<b>Summenblatt</b>

Instituts-nummer:  Prüfziffer:   
 Institutsgruppe/  
 Finanzholding-Gruppe:

Übergeordnetes  
 Unternehmen:   
 Stand Ende:

**in Mio Euro**

		Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositionen	Synthetische Verbriefung: Auf das verbriefte Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechniken			Verbriefungs- positionen	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten auf die IRBA-Bemessungsgrundlage				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	IRBA-Bemessungsgrundlage nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeiterneigte Beträge
			(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeiterneigte Beträge (a)	(-) Abgänge insgesamt	Um Währungsinkongruenzen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 S.4 V)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Inkongruenzenbereinigte Beträge	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Substitutionseffekte durch Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken auf die IRBA-Bemessungsgrundlage		
		01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11
010	<b>Gesamtsumme</b>											
011	darunter: Wiederverbriefungspositionen											
020	<b>Originator: Gesamtengagement</b>											
030	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
031	A											
032	B											
033	C											
034	D											
035	E											
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen											
071	A											
072	B											
073	C											
074	D											
075	E											
080	Vorzeitige Tilgung											

(a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche

Blatt 1



**58. Meldung über IRBA-Positionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**IRBA QV**

**IRBA-Forderungs-  
klasse:**

**Verbriefungsart:**

<b>Verbriefungen</b>
<b>Summenblatt</b>

Instituts-nummer:

Institutsgruppe/  
Finanzholding-Gruppe:

Prüfziffer:

Übergeordnetes  
Unternehmen:

Stand Ende:

in Mio Euro

(+) Kreditrisikominderungsstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und lauffzeitberichtigte Beträge										
IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionseffekten										
Kreditrisikominderungsstechniken mit Substitutionsgrundlage		Substitutionseffekte durch Anwendung von Kreditrisikominderungsstechniken auf die IRBA-Bemessungsgrundlage		Zulüsse insgesamt		(-) Abgänge insgesamt				
Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche : Inkongruenzberichtigte Beträge		Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzberichtigte Beträge		IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 251 Abs. 1 SdWV)		Nominalbetrag zurückbehaltener oder zurückgeworbener Kreditbesicherung		(-) Abgänge insgesamt		Um Währungsinkongruenzen berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate
Verbriefungspositionen		IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungsstechniken (§ 251 Abs. 1 SdWV)		05		04		03		02
Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositionen		01		02		03		04		05
Investor: Gesamtengagement										
darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist										
Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen										
A										
B										
C										
D										
E										
Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen										
A										
B										
C										
D										
E										
Sponsor: Gesamtengagement										
Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen										
Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen										
(a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche										

**58. Meldung über IRBA-Positionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**IRBA QV**

**IRBA-Forderungs-  
klasse:**

**Verbriefungsart:**

<b>Verbriefungen</b>	Instituts- nummer:	Prüf- ziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:
<b>Summenblatt</b>	Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:

in Mio Euro

		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungsstechniken	Aufgliederung der IRBA-Bemessungsgrundlage aus Spalte (12) von außerbilanziellen Positionen nach IRBA-Konversionsfaktoren				IRBA-Positionswert (§ 252 SolV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 268 SolV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugspositionen	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten																	
			0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%				Ratingbasierter Ansatz (Bonitätsstufe 1 bis 11 bei Langfristrating)																	
										7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	150%	200%	225%	250%	300%	350%	425%	500%	650%	750%	850%		
		12	13	14	15	16	17	18	19=17+18	20	21	22	23	24	42	43	44	25	45	46	26	47	27	48	49		
010	Gesamtsumme																										
011	darunter: Wiederverbriefungs- positionen																										
020	Originator: Gesamtengagement																										
030	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																										
031	A																										
032	B																										
033	C																										
034	D																										
035	E																										
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																										
071	A																										
072	B																										
073	C																										
074	D																										
075	E																										
080	Vorzeitige Tilgung																										

Blatt 3

Blatt 3

**58. Meldung über IRBA-Positionen  
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**IRBA QV**

**IRBA-Forderungs-  
klasse:**

**Verbriefungsart:**

<b>Verbriefungen</b>	Instituts- nummer:	Prüf- ziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:
<b>Summenblatt</b>	Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:

in Mio Euro

	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikomodifizierungstechniken	Aufgliederung der IRBA- Bemessungsgrundlage aus Spalte (12) von außerbilanziellen Positionen nach IRBA- Konversionsfaktoren				IRBA-Positionswert (\$ 252 S.4v)	(-) Abzug vom Eigenkapital (\$ 268 S.4v)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugpositionen 19=17+ 18	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten									
		0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%				Ratingbasierter Ansatz (Bonitätsstufe 1 bis 11 bei Langfristrating)									
		13	14	15	16	17	18	19=17+ 18	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29
Investor: Gesamtengagement																		
darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																		
Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																		
A																		
B																		
C																		
D																		
E																		
Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																		
A																		
B																		
C																		
D																		
E																		
Sponsor: Gesamtengagement																		
Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen																		
Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																		

Blatt 4

## 58. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QV

IRBA-Forderungs-  
klasse:

Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Instituts-  
nummer:Prüf-  
ziffer:Institutsgruppe/  
Finanzholding-Gruppe

Übergeordnetes Unternehmen:

Stand  
Ende:

in Mio Euro

in Mio EUR														
Aggregierte Kapitalanforderungen														
nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen														
Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen														
Zuschlagbetrag auf den risikogewichteten KSA/IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen														
Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 SolV) bei Verstoß gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)														
Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 SolV)														
(-) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen														
Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten														
1250%														
Bankaufsichtlicher Formel-Ansatz														
Durchschnittliche Risikogewichtung (%)														
Internes Einstufungsverfahren														
Durchschau														
Durchschnittliche Risikogewichtung (%)														
Ohne Rating														
Mit Rating														
28														
29														
30														
31														
32														
33														
34														
35														
36														
40														
41														
37														
38														
39														
010	Gesamtsumme													
011	darunter: Wiederverbriefungs- positionen													
020	Originator: Gesamtengagement													
030	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen													
031	A													
032	B													
033	C													
034	D													
035	E													
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen													
071	A													
072	B													
073	C													
074	D													
075	E													
080	Vorzeitige Tilgung													
Blatt 4														

## 58. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA QV

IRBA-Forderungs-  
klasse:

Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Instituts-  
nummer:Prüf-  
ziffer:Institutsgruppe/  
Finanzholding-Gruppe

Übergeordnetes Unternehmen:

Stand  
Ende:

in Mio Euro

Aggregierte Kapitalanforderungen																39					
nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA-Verbriefung zu anderen Forderungsklassen																38					
Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen																37					
Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten KSA-/IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen																41					
Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 SolV) bei Verstoß gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)																40					
Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 SolV)																36					
(-) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen																35					
Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten																					
								Durchschnittliche Risikogewichtung (%)													
								Internes Einstufungsverfahren													
								Durchschau													
								Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Bankaufsichtlicher Formel-Ansatz												
								1250%													
								Ohne Rating													
								Mit Rating													
								28	29	30	31	32	33	34	35	36	40	41	37	38	39
Investor:																					
Gesamtengagement																					
darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																					
Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																					
A																					
B																					
C																					
D																					
E																					
Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																					
A																					
B																					
C																					
D																					
E																					
Sponsor:																					
Gesamtengagement																					
Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																					
Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																					

Blatt 6

Q VERSO

## 59. Sonderangaben zu den Verbriefungspositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

Institutsnummer:	Übergeordnetes Unternehmen:	Institutgruppe/ Finanzholding-Gruppe:	Stand Ende:
Prüfziffer:			

  

in Mio Euro																													
Aggregierte Kapitalanforderungen	29																												
Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	28																												
(-) Abzugsbetrag für Verbriefungspositionen	27																												
Verbriefungspositionen (Bemessungsgrundlage vor Konversionsfaktoren)	<table border="1"> <tr> <td rowspan="2">Vorzeitige Tilgungsmöglichkeit</td> <td>Angewandter Konversionsfaktor</td> <td>26</td> </tr> <tr> <td>Kontrolliert? (ja/nein)</td> <td>25</td> </tr> <tr> <td rowspan="3">Außerbilanzielle Positionen und Derivate</td> <td>Sonstige</td> <td>24</td> </tr> <tr> <td>Qualifizierte Verbriefungs-Liquiditätsfazilität</td> <td>23</td> </tr> <tr> <td>Direktes Kreditsubstitut</td> <td>22</td> </tr> <tr> <td rowspan="8">Bilanzpositionen</td> <td rowspan="2">Erstverlusterposition</td> <td>ohne Rating</td> <td>21</td> </tr> <tr> <td>Rating</td> <td>20</td> </tr> <tr> <td rowspan="2">Mezzanine</td> <td>ohne Rating</td> <td>19</td> </tr> <tr> <td>Rating</td> <td>18</td> </tr> <tr> <td rowspan="2">Höchststrangig</td> <td>ohne Rating</td> <td>17</td> </tr> <tr> <td>Rating</td> <td>16</td> </tr> </table>	Vorzeitige Tilgungsmöglichkeit	Angewandter Konversionsfaktor	26	Kontrolliert? (ja/nein)	25	Außerbilanzielle Positionen und Derivate	Sonstige	24	Qualifizierte Verbriefungs-Liquiditätsfazilität	23	Direktes Kreditsubstitut	22	Bilanzpositionen	Erstverlusterposition	ohne Rating	21	Rating	20	Mezzanine	ohne Rating	19	Rating	18	Höchststrangig	ohne Rating	17	Rating	16
Vorzeitige Tilgungsmöglichkeit	Angewandter Konversionsfaktor		26																										
	Kontrolliert? (ja/nein)	25																											
Außerbilanzielle Positionen und Derivate	Sonstige	24																											
	Qualifizierte Verbriefungs-Liquiditätsfazilität	23																											
	Direktes Kreditsubstitut	22																											
Bilanzpositionen	Erstverlusterposition	ohne Rating	21																										
		Rating	20																										
	Mezzanine	ohne Rating	19																										
		Rating	18																										
	Höchststrangig	ohne Rating	17																										
		Rating	16																										
	Verbriefungsstruktur	Erstverlusterposition	15																										
	Verbriefte Positionen	Eigenkapitalanforderungen vor Verbriefung %	14																										
(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen		13																											
ELGD %		12																											
Anzahl der Positionen		11																											
Verwendeter Ansatz (SA/IRB/MIX)		10																											
Art		09																											
Anteil des Instituts (%)		08																											
Gesamtbetrag	07																												
Verbriefungen ohne ABCP-Programme	Gesamtbetrag der verbrieften Positionen zu Beginn der Verbriefung	06																											
	Datum der Verbriefung (MM/JJJJ)	05																											
Stellung des Instituts: (SPONSOR / ORIGINATOR/ URSPRÜNGLICHER KREDITGEBER)		04																											
Selbstbehalt (§ 18a Abs. 1 KWG)	Einhaltung der Anforderung an den Selbstbehalt	33																											
	%-Anteil des Selbstbehalts zum Meldestichtag	31																											
	Art des Selbstbehalts	30																											
Verbriefung/ Wiederverbriefung		32																											
Verbriefungsart (Synthetisch / Traditionell)		03																											
Kennung der Verbriefung		02																											
Interner Code		01																											

60. Meldung über Abwicklungsrisikopositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

Instituts- nummer	Prüfziffer:	
Überge- ordnetes Unter- nehmen:	Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe	Stand Ende:

		in Mio Euro		
	Geschäftstage nach vereinbartem Abrechnungstermin	Vereinbarter Abrechnungspreis	Zugunsten des Institutes bestehender Unterschiedsbetrag	Eigenkapitalanforderung (§ 16 SolvV)
		01	02	03
010	Gesamtsumme			
011	Gesamtsumme Anlagebuch			Übertrag ÜB-Meldebogen
020	0 bis 4			
030	5 bis 15			
040	16 bis 30			
050	31 bis 45			
060	mehr als 45			
070	Gesamtsumme Handelsbuch			Übertrag ÜB-Meldebogen
080	0 bis 4			
090	5 bis 15			
100	16 bis 30			
110	31 bis 45			
120	mehr als 45			

# 61. Meldung zum operationellen Risiko (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

Q OPR

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes  
Unternehmen:

99901	Angabe des Geschäftsjahres, auf das sich die Spalten 3 und 6 beziehen
-------	---

Institutsgruppe/  
Finanzholding-Gruppe:

Maßgebliches Geschäftsjahr bezogen auf Spalte 3 und 6

in Mio Euro

in Mio Euro														
Geschäftsfelder	Relevanter Indikator (Bruttoertrag) nach § 271 SolvV			Nominales Kreditvolumen (nur erforderlich bei Verwendung eines alternativen Indikators) nach § 274 (3) SolvV			Eigenkapitalanforderungen (§§ 270, 273, 274 und 278 SolvV)	Aufgrund gruppeninterner Allokationsmechanismen zugeordnete Eigenkapitalanforderungen (§ 278 Abs. 4 SolvV) (b)	Nachrichtlich Angabene (bei Verwendung fortgeschrittener Messansätze)					
									Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlagerung (§ 292 SolvV)	(-) Reduzierung der Eigenkapitalanforderungen aufgrund der Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlagerung (§ 292 SolvV)	(-) Reduzierung der Eigenkapitalanforderungen aufgrund der erwarteten Verluste in den internen Geschäftspraktiken (§ 284 Abs. 2 SolvV)	Berücksichtigung von Reduktionseffekten aufgrund angemessener Berücksichtigung des erwarteten Verlustes in den internen Geschäftspraktiken und vor Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlagerung (§ 292 SolvV)	Höhe des Überschreibungsbetrages der in § 292 Abs. 1 Satz 2 SolvV festgelegten Höchstgrenze bei der Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlagerung	
	01	02	03	04	05	06								07
010 1. Basisindikatoransatz (BIA)							Übertrag ÜB-Meldbogen							
020 2. Gesamtheit der unter den Standardansatz (STA) / Alternativen Standardansatz (ASA) fallenden Geschäftstätigkeiten							Übertrag ÜB-Meldbogen							
030 <u>Zuordnung der Geschäftstätigkeiten im Standardansatz nach Geschäftsfeld:</u>														
040 Unternehmensfinanzierung, -beratung														
050 Handel														
060 Wertpapierprovisionsgeschäft														
070 Firmenkundengeschäft														
080 Privatkundengeschäft														
090 Zahlungsverkehr und Abwicklung														
100 Depot- und Treuhandgeschäft														
110 Vermögensverwaltung														
120 <u>Zuordnung der Geschäftstätigkeiten im Alternativen Standardansatz nach Geschäftsfeld:</u>														
130 Firmenkundengeschäft														
140 Privatkundengeschäft														
150 3. Fortgeschrittene Messansätze (AMA) (a)							Übertrag ÜB-Meldbogen							

(a) Informationen zum relevanten Indikator sind nur im Falle einer Kombination eines fortgeschrittenen Messansatzes mit dem Basisindikator- bzw. Standardansatz erforderlich

(b) ohne Berücksichtigung der inländischen Tochterunternehmen, auf die § 2a Abs.1 KWG angewendet wird



Instituts- nummer:	Prüfziffer:	Übungsordnetes Unternehmen:	Stand Ende:	In Mio Euro		
	Potenzieller Risikobetrag		Potenzieller Krisen-Risikobetrag	Zuschlagsbetrag für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko		
	Gewichtungsfaktor x Durchschnitt der potenziellen Risikobeträge der letzten 60 Geschäftstage	Potenzieller Risikobetrag vom Vorlag	Gewichtungsfaktor x Durchschnitt der potenziellen Krisen- Risikobeträge der letzten 60 Geschäftstage	Zwölfwöchiger Durchschnitt der nach §§ 318a bis 318d SolvV ermittelten Beträge für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko		
	01	02	08	09	10	11
010 Positionen						
Nachrichtlich; gegliedert nach Marktrisiko-Kategorien						
020 1 Zinssnettoposition						
030 1.1 Allgemeines Kursrisiko						
040 1.2 Besonderes Kursrisiko						
050 2 Aktiennettoposition						
060 2.1 Allgemeines Kursrisiko						
070 2.2 Besonderes Kursrisiko						
080 3 Währungsgesamt-position						
090 4 Rohwarenposition						
100 5 Gesamtbetrag für das allgemeine Kursrisiko						
110 6 Gesamtbetrag für das besondere Kursrisiko						

62. Meldung über Marktrisikopositionen Verwendung eigener Risikomodelle (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

Q IM

Institutsnummer:	Prüfziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:	Stand Erde:
------------------	-------------	-----------------------------	-------------

		Anrechnungsbeträge für das Correlation Trading Portfolio					Nachrichtlich:					in Mio Euro	
		Mindestanrechnungsbetrag für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 4 SolvV)	Zwölfwöchiger Durchschnitt der nach § 318e SolvV zuletzt ermittelten Beträge für das Correlation Trading Portfolio	Nach § 318e SolvV zuletzt ermittelter Betrag für das Correlation Trading Portfolio	Zusätzliche Eigenkapitalanforderung für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 3)	Eigenmittelanforderung	Anzahl der Ausnahmen in den letzten 250 Geschäftstagen	Gewichtungsfaktor nach § 314 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 Buchstabe b SolvV	Gewichtungsfaktor nach § 314 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 Buchstabe b SolvV	Summe der Berücksichtigungsbeträge für aktivisch ausgerichtete Zinsnettopositionen des Correlation Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 1 SolvV)	Summe der Berücksichtigungsbeträge für passivisch ausgerichtete Zinsnettopositionen des Correlation Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 2 SolvV)		
		12 = 8% * Max [18, 19]	13	14	15	'05=Max [01,02] + Max [08,09] + Max [10,11] + Max [12,13,14] + 15	06	16	17	18	19		
010	Positionen					Übertrag UB-Meldebogen							
	Nachrichtlich: gegliedert nach Marktrisikokategorien												
020	1 Zinsnettoposition												
030	1.1 Allgemeines Kursrisiko												
040	1.2 Besonderes Kursrisiko												
050	2 Aktiennetto-position												
060	2.1 Allgemeines Kursrisiko												
070	2.2 Besonderes Kursrisiko												
080	3 Währungsgesamt-position												
090	4 Rohwarenposition												
100	5 Gesamtbetrag für das allgemeine Kursrisiko												
110	6 Gesamtbetrag für das besondere Kursrisiko												
												Blatt 2	

63. Marktrisikomeldung Währungsgesamtposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

MKR QFW

Übergeordnetes Unternehmen: \_\_\_\_\_

Stand Ende: \_\_\_\_\_

Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüfziffer: \_\_\_\_\_ Instituts-/Finanzholding-Gruppe: \_\_\_\_\_

Ort: \_\_\_\_\_

- in Mio Euro -

Positionen		Insgesamt (Spalte 02 bis 07)	USD 02	GBP 03	CHF 04	JPY 05	CAD 06	Übrige Fremdwährungen 07	Gold 08
<b>Aktivpositionen</b>									
1. Bilanzierbare Vermögensgegenstände einschl. zeitanteiliger Erträge	010								
2. Liefer- und Zahlungsansprüche aus Kassageschäften	020								
sonstige Derivate ohne Optionsrechte der Positionen 3 und 4	030								
Ansprüche auf Zahlung von Kapitalbeträgen aus Finanz-Swaps	040								
3. Als Optionsberechtigter/Stillhalter zustehende Liefer- oder Zahlungsansprüche aus Devisen- oder Goldoptionen	050								
4. Sonstige eigene Optionsrechte	060								
5. Sonstige Aktivpositionen	070								
<b>Aktivpositionen insgesamt</b>		100							
<b>Passivpositionen</b>									
1. Bilanzierbare Schulden einschließlich zeitantelliger Aufwendungen	110								
2. Liefer- und Zahlungsverpflichtungen aus Kassageschäften	120								
sonstige Derivate ohne Optionsrechte der Positionen 3 und 4	130								
Verpflichtungen zur Zahlung von Kapitalbeträgen aus Finanz-Swaps	140								
3. Als Optionsberechtigter/Stillhalter zu erfüllende Liefer- oder Zahlungsverpflicht. aus Devisen- oder Goldoptionen	150								
4. Sonstige fremde Optionsrechte	160								
5. Sonstige Passivpositionen	170								
<b>Passivpositionen insgesamt</b>		200							
Offene Einzelwährungsposition	210	+	+	+	+	+	+	+	+
Nettowährungsposition (der größere Betrag - ohne Vorzeichen - der Zeilen 210/01 oder 220/01)	220	./	./	./	./	./	./	./	./
abzüglich 50 % der ausgleichenden Währungsposition in eng verbundenen Währungen	230								
zuzüglich offene Goldposition (Betrag der Zeile 230/08)	240	./							
zuzüglich des Anrechnungsbetrages für Investmentanteile nach § 294 Abs. 6 Satz 6 SolvV	250	+							
Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV	255	+							
Nettoabgrenzungsbetrag für zellant. Erträge/Aufwendungen (der für Institute, bei denen die Abgrenzung nicht zur Fremdwährung verlangt ist)	260	+							
Währungsgesamtposition (Summe der Zeilen 230 bis 270)	270	+							
		280							

Nachrichtlich:

Strukturelle Währungspositionen nach § 4 Abs. 4 SolvV

Abzugsposten in Fremdwährung nach § 4 Abs. 4 SolvV

99001

99002

99003

x 8,0 %

Anrechnungsbetrag für Währungsgesamtposition

**64. Marktrisikomeldung Rohwarenposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**
**MKR QRW**

Übergeordnetes Unternehmen: \_\_\_\_\_ Stand: \_\_\_\_\_  
 Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüfziffer: \_\_\_\_\_ Instituts-/Finanzholding-Gruppe: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_

- in Mio Euro -

Positionen		Insgesamt	Öle, Petroleum und Gas	Landwirtschaftl. Erzeugnisse	Metalle	Übrige Rohwaren
		01	02	03	04	05
<b>Aktivpositionen</b>						
1. Unter Aktiva der Bilanz auszuweisende Rohwarenbestände	010					
2. Lieferansprüche aus Kassageschäften	020					
Termingeschäften	030					
Swapgeschäften	040					
3. Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zustehende Lieferansprüche	050					
4. Eventualansprüche auf Rückgabe von in Pension gegebenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	060					
<b>Aktivpositionen insgesamt</b>	100					
<b>Passivpositionen</b>						
1. Lieferverpflichtungen aus Kassageschäften	110					
Termingeschäften	120					
Swapgeschäften	130					
2. Als Optionsberechtigter/Stillhalter zu erfüllende Lieferverpflichtungen	140					
3. Eventualverbindlichkeiten auf Rückgabe von in Pension genommenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	150					
<b>Passivpositionen insgesamt</b>	200					

**I. Vereinfachtes Verfahren**

		01	02	03
Summe der Aktiv- und Passivpositionen	210		x 3,0 %	
Summe der offenen Rohwareneinzelpositionen	220		x 15,0 %	
	230	<b>Summe A</b>		

**II. Zeitfächermethode**

		01	02	03
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen nach § 297 Abs. 2 Satz 3 SolvV	300		X 0 %	
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen vor und nach der Verrechnung zwischen den Zeitfächern	310		x 3,0 %	
Summe der offenen Bereichspositionen nach Verrechnung	320		x 0,6 %	
Verbleibende offene Bereichsposition	330		x 15,0 %	
	340	<b>Summe B</b>		
	350	<b>Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV</b>		
	360	<b>Anrechnungsbetrag für Rohwarenposition (Zeile 230+340+350)</b>		

65. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

MKR QZK

Übergeordnetes Unternehmen: \_\_\_\_\_ Prüfziffer: \_\_\_\_\_ Instituts-/Finanzholding-Gruppe: \_\_\_\_\_ Stand Ende: \_\_\_\_\_ Blatt 1  
 Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_

Allgemeines Kursrisiko Zinsnettoposition										- in Mio Euro -
		Insgesamt (Summe aus Spalten 02 bis 16)		Kurzfristige Laufzeitzone				Mittelfristige Laufzeitzone		
	Nominalverzinsung < 3 % bzw. gemäß Duration			bis zu einem Monat	über einem bis zu drei Monaten	über drei bis zu sechs Monaten	über sechs Monaten bis zu einem Jahr	über einem bis zu 1,9 Jahren	über 1,9 bis zu 2,8 Jahren	über 2,8 bis zu 3,6 Jahren
	Nominalverzinsung ≥ 3 %			bis zu einem Monat	über einem bis zu drei Monaten	über drei bis zu sechs Monaten	über sechs Monaten bis zu einem Jahr	über einem bis zu 2 Jahren	über 2 bis zu 3 Jahren	über 3 bis zu 4 Jahren
		01		02	03	04	05	06	07	08
I. Jahresbandmethode Zinsnettoposition Insgesamt	aktivische Ausrichtung		110							
	passivische Ausrichtung		120							
	aktivische Ausrichtung		130							
	passivische Ausrichtung		140							
darunter: in Euro	aktivische Ausrichtung		150							
	passivische Ausrichtung		160							
darunter: in US-\$	aktivische Ausrichtung		170							
	passivische Ausrichtung		180							
II. Durationmethode: Zinsnettoposition Insgesamt	aktivische Ausrichtung		190							
	passivische Ausrichtung		200							
gewichtete Zinsnettoposition Insgesamt	aktivische Ausrichtung		210							
	passivische Ausrichtung		220							
darunter: gewichtete Zinsnettoposition in Euro	aktivische Ausrichtung		230							
	passivische Ausrichtung		240							
Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolV			250							
Teilanrechnungsbetrag für das allgemeine Kursrisiko			300							

**65. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

**MKR QZK**

Übergeordnetes Unternehmen: \_\_\_\_\_ Stand Ende: \_\_\_\_\_ Blatt 2  
 Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüfziffer: \_\_\_\_\_ Instituts-/Finanzholding-Gruppe: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_

**Allgemeines Kursrisiko Zinsnettoposition**

- in Mio Euro -

		Langfristige Laufzeitzone							
		über 3,6 bis zu 4,3 Jahren	über 4,3 bis zu 5 Jahren	über 5 bis zu 7 Jahren	über 7 bis zu 10 Jahren	über 10 bis zu 15 Jahren	über 15 bis zu 20 Jahren	über 20,0 Jahren	
		09	10	11	12	13	14	15	16
I. Jahresbandmethode Zinsnettoposition Insgesamt	Nominalverzinsung < 3 % bzw. gemäß Duration	110							
	Aktivische Ausrichtung								
	Passivische Ausrichtung	120							
	Insgesamt								
darunter: in Euro	Aktivische Ausrichtung	130							
	Passivische Ausrichtung	140							
	Insgesamt								
darunter: in US-\$	Aktivische Ausrichtung	150							
	Passivische Ausrichtung	160							
	Insgesamt								
II. Durationsmethode: Zinsnettoposition Insgesamt	Aktivische Ausrichtung	170							
	Passivische Ausrichtung	180							
	Insgesamt								
gewichtete Zinsnettoposition Insgesamt	Aktivische Ausrichtung	190							
	Passivische Ausrichtung	200							
	Insgesamt								
darunter: gewichtete Zinsnettoposition in Euro	Aktivische Ausrichtung	210							
	Passivische Ausrichtung	220							
	Insgesamt								
darunter: gewichtete Zinsnettoposition in US-\$	Aktivische Ausrichtung	230							
	Passivische Ausrichtung	240							
	Insgesamt								

65. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

MKR QZK

Übergeordnetes Unternehmen: \_\_\_\_\_ Stand Ende: \_\_\_\_\_ Blatt 3  
Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüfziffer: \_\_\_\_\_ Instituts-/Finanzholding-Gruppe: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_

Besonderes Kursrisiko Zinsnettoposition					- in Mio Euro -	
Positionen	Zinsnettoposition	Gewichtungssätze	risikogewichtete Zinsnettoposition	Gewichtung nach § 303 Abs. 1	Anrechnungsbeträge	
					04	05
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 2 und Abs. 2a	310	x 0,0 %				
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 3	320	x 3,125 %				
Restlaufzeit bis 6 Monate	330	x 12,5 %				
Restlaufzeit über 6 Monate bis zu 2 Jahren	340	x 20,0 %				
Restlaufzeit von mehr als 2 Jahren	350	x 100,0 %				
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 1	360	x 150,0 %				
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 4	380					
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 6	400					
Summe Zinsnettopositionen						
	410	Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV				
	420	Teilanzrechnungsbetrag für das besondere Kursrisiko				

Pauschalierter Anrechnungsbetrag für Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 1 und 2 SolvV

Positionen	Maßgeblicher Betrag	Gewichtungssätze	Anrechnungsbeträge
	01	02	03
Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 1	500	X 32 %	
Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 2	510	X 40 %	
Summe	520		

66. Marktrisikomeldung Aktiennetttoposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe) MKR QAK

Institutsnummer: \_\_\_\_\_ Prüfziffer: \_\_\_\_\_ Name: \_\_\_\_\_ Stand Ende: \_\_\_\_\_ Ort: \_\_\_\_\_

Nationaler Markt des Emittenten	Aktiennettoeinzelpositionen		Aktiennetttoposition (saldierte Netttoposition)	Anrechnungsbeträge für das allgemeine Kursrisiko Spalte 03 x 8,0 %	Aktienbrutttoposition	Anrechnungsbeträge für das besondere Kursrisiko Spalte 08 x 8,0%
	aktive Ausrichtung 01	passive Ausrichtung 02				
Deutschland 010			03	04	08	09
Frankreich 020						
Großbritannien 030						
Japan 040						
USA 050						
übrige Länder 060						
070	Teilarrechnungsbetrag für das allgemeine Kursrisiko (Summe der Spalte 04)			A	Summe	
080	Teilarrechnungsbetrag für das besondere Kursrisiko (Summe der Spalte 09)			B		
090	Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV für das allgemeine Kursrisiko			C		
100	Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV für das besondere Kursrisiko			D		
110	Anrechnungsbetrag für Aktiennetttoposition (A+B+C+D)			E		



**67. Zusatzinformationen zu den gruppenangehörigen Unternehmen:**  
**Gruppensolvabilitätsbeitrag**

**QZU**

Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:		Institutgruppe/ Finanzholding-Gruppe	
Stand Ende:							

				in Mio Euro	
in den bankaufsichtlichen Konsolidierungskreis einbezogene Unternehmen*		Beitrag zu folgenden Eigenkapitalanforderungen			Beitrag zu den Eigenmitteln
		Adressrisiken	Marktrisiko	darunter: Kernkapital	
01	CODE 02	04	05	03= 04+ 05	06

\* ohne Berücksichtigung der inländischen Tochterunternehmen, auf die § 2a Abs. 1 KWG angewendet wird

## 68. Marktrisikomeldungen Verbriefungspositionen

MKR EV

Institutsnummer:	<input type="text"/>	Prüfziffer:	<input type="text"/>	Name:	<input type="text"/>
Ort:	<input type="text"/>	Stand Ende:	<input type="text"/>		

in Tsd Euro																														
		Verbriefungspositionen		(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 303 Abs. 2 Nr. 3 SolvV)		Zinsnettopositionen		Aufgliederung der Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung nach Risikogewichten																						
								Risikogewichte < 1250%										1250%		Bankaufsichtlicher Formelansatz		Durchschnitt		Internes Einstufungsverfahren		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)				
		Positionen mit aktivischer Ausrichtung	Positionen mit passivischer Ausrichtung	Positionen mit aktivischer Ausrichtung	Positionen mit passivischer Ausrichtung	Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung	7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	150%	200%	225%	250%	300%	350%	425%	500%	650%	750%	850%	Ohne Rating	MA-Rating	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschnitt	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)		
		01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29
010	Gesamtsumme																													
020	darunter: Wiederverbriefungspositionen																													
030	Originator: Gesamtengagement																													
040	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																													
050	Wiederverbriefungspositionen																													
060	Investor: Gesamtengagement																													
070	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																													
080	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																													
090	Wiederverbriefungspositionen																													
100	Sponsor: Gesamtengagement																													
110	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																													
120	Wiederverbriefungspositionen																													
		Aufgliederung der Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen nach Art der verbrieften Positionen																												
130	Risikopositionen, die durch Wohnimmobilien besichert sind																													
140	Risikopositionen, die durch gewerbliche Immobilien besichert sind																													
150	Risikopositionen aus dem Kreditkartengeschäft																													
160	Forderungen aus dem Leasinggeschäft																													
170	Risikopositionen gegenüber Unternehmen und KMU's, die der Forderungskategorie Unternehmen zugerechnet werden																													
180	Konsumentenkredite																													
190	Forderungen aus Lieferungen und Leistungen																													
200	Verbriefungspositionen																													
210	Sonstige Risikopositionen																													

## MKR EV

Name:	
Stand Ende:	

Blatt 2

## 69. Marktrisikokmeldungen Correlation Trading Portfolio

MKR ECTP

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

in Tsd Euro

		Correlation Trading Portfolio-Positionen		(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 303 Abs. 2 Nr. 3 SolvV)		Zinsnettopositionen		Aufgliederung der Nettopositionen mit aktivischer Ausrichtung nach Risikogewichten															
								Risikogewichte < 1250%					1250%		Bankaufsichtlicher Formelansatz		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)		Internes Einstufungsverfahren		Andere Risikogewichte		
		Positionen mit aktivischer Ausrichtung		Positionen mit passivischer Ausrichtung		Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung																	Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung
		01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22
010	Gesamtsumme																						
020	Originator: Gesamtengagement																						
030	Verbriefungspositionen																						
040	Sonstige Correaltion Trading Portfolio-Positionen																						
050	Investor: Gesamtengagement																						
060	Verbriefungspositionen																						
070	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																						
080	Sponsor: Gesamtengagement																						
090	Verbriefungspositionen																						
100	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																						
	Nth-to-default-Kreditderivate																						
110	Nth-to-default-Kreditderivate																						
120	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																						

Blatt 1

69. Marktrisikomeldungen Correlation Trading Portfolio

MKR ECTP

Institutsnummer:  Prüfziffer:

Ort:

Name:

Stand Ende:

in Tsd Euro

		Aufgliederung der Nettopositionen mit passivischer Ausrichtung nach Risikogewichten														Risikogewichtete Zinsnettopositionen vor Anwendung der Kappungsregel in § 303 Abs. 1 Satz 3 SolvV		Risikogewichtete Zinsnettopositionen nach Anwendung der Kappungsregel in § 303 Abs. 1 Satz 3 SolvV		Aggregierte Kapitalanforderungen				
		Risikogewichte < 1250%						1250%		Bankaufsichtlicher Formelansatz		Durchschau	Internes Einstufungsverfahren		Andere Risikogewichte									
													Durchschnittliche Risikogewichtung (%)		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)		Durchschnittliche Risikogewichte							
		7 - 10%		12 - 18%		20 - 35%		40 - 75%		100%		250%		350%		425%		650%			Ohne Rating		Mit Rating	
		24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	34	35	36	37	38	39	40	riskogewichtete Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung		riskogewichtete Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung	riskogewichtete Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	riskogewichtete Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung	
																	41	42	43	44	45			
010	Gesamtsumme																					Übertrag ÜB-Meldebogen		
020	Originator: Gesamtengagement																							
030	Verbriefungspositionen																							
040	Sonstige Correaltion Trading Portfolio-Positionen																							
050	Investor: Gesamtengagement																							
060	Verbriefungspositionen																							
070	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																							
080	Sponsor: Gesamtengagement																							
090	Verbriefungspositionen																							
100	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																							
	Nth-to-default-Kreditderivate																							
110	Nth-to-default-Kreditderivate																							
120	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																							
																					Blatt 2			

## MKR QV

Institutsnummer:		Prüfziffer:		Name:	
Ort:				Stand:	
				Ende:	

in Tsd Euro

[illegible]

## 70. Marktrisikokmeldungen Verbriefungspositionen MKR QV

MKR QV

Institutsnummer:	Prüfziffer:
Ort:	

Name:
Stand Ende:

in Tsd Euro

		Aufgliederung der Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung nach Risikogewichten	Zuschlag zu den risikogewichteten Zinsnettopositionen bei Verstoß gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)	Risikogewichtete Zinsnettopositionen vor Anwendung der Kappungsregel in § 303 Abs. 1 Satz 3 SolvV	Risikogewichtete Zinsnettopositionen nach Anwendung der Kappungsregel in § 303 Abs. 1 Satz 3 SolvV	Aggregierte Kapitalanforderungen																																																																																																																																																		
							Risikogewichte < 1250%	1250%	Bankaufsichtlicher Formelansatz	Internes Einstufungsverfahren	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen

## 71. Marktrisikomeldungen Correlation Trading Portfolio

MKR QCTP

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand:

Ende:

in Tsd Euro

		Correlation Trading Portfolio-Positionen		(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 303 Abs. 2 Nr. 3 SolvV)		Zinsnettopositionen		Aufgliederung der Nettopositionen mit aktivischer Ausrichtung nach Risikogewichten																		
								Risikogewichte < 1250%					1250%		Bankaufsichtlicher Formelansatz		Durchschau		Internes Einstufungsverfahren		Andere Risikogewichte					
		Positionen mit aktivischer Ausrichtung	Positionen mit passivischer Ausrichtung	Positionen mit aktivischer Ausrichtung	Positionen mit passivischer Ausrichtung	Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung															7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%
								01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11	12	13	14					
010	Gesamtsumme																									
020	Originator: Gesamtengagement																									
030	Verbriefungspositionen																									
040	Sonstige Correaltion Trading Portfolio-Positionen																									
050	Investor: Gesamtengagement																									
060	Verbriefungspositionen																									
070	Sonstige Correaltion Trading Portfolio-Positionen																									
080	Sponsor: Gesamtengagement																									
090	Verbriefungspositionen																									
100	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																									
Nth-to-default-Kreditderivate																										
110	Nth-to-default-Kreditderivate																									
120	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																									

Blatt 1



**71. Marktrisikomeldungen Correlation Portfolio**
**MKR QCTP**

Institutsnummer:		Prüfziffer:		Name:	
Ort:				Stand Ende:	

in Tsd Euro

		Aufgliederung der Nettopositionen mit passivischer Ausrichtung nach Risikogewichten												Risikogewichtete Zinsnettopositionen vor Anwendung der Kappungsregel in § 303 Abs. 1 Satz 3 SolvV		Risikogewichtete Zinsnettopositionen nach Anwendung der Kappungsregel in § 303 Abs. 1 Satz 3 SolvV		Aggregierte Kapitalanforderungen						
		Risikogewichte < 1250%										1250%							Bankaufsichtlicher Formelansatz		Interne Einstufungsverfahren		Andere Risikogewichte	
		24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	34	35	36	37	38	39		40	41	42	43	44	45
010	Gesamtsumme																					Übertrag ÜB-Meldebogen		
020	Originator: Gesamtengagement																							
030	Verbriefungspositionen																							
040	Sonstige Correaltion Trading Portfolio-Positionen																							
050	Investor: Gesamtengagement																							
060	Verbriefungspositionen																							
070	Sonstige Correaltion Trading Portfolio-Positionen																							
080	Sponsor: Gesamtengagement																							
090	Verbriefungspositionen																							
100	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																							
	Nth-to-default-Kreditderivate																							
110	Nth-to-default-Kreditderivate																							
120	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																							

Blatt 2

