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:	Prüfziff	er:
Name:	Ort:	
Stand Ende:	Sachbe beiter/	
	Telefo	n:

			in Tsd 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
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 ausgewiesenene Bilanzgewinns 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
M	larktrisikopositionen und zum operationellen Risiko	

man itti iomtopooi	monon ana zam oporanomom mo		
Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Name:		Ort:	
Stand Ende:		Sachbear- beiter/in:	
		Telefon:	

in	heT	Euro	

			in Tsd Euro	
	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0120	1.1.2.2	Anteile in Fremdbesitz (minority interest)		=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	Zwischengewinn / Zwischenverlust (aufsichtlich)		= 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 § 10 Abs. 3 KWG 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		
				Blatt 2

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

man itti iomtopoo	monon una zum operationem memo	
Institutsnummer:	Prüfziffer:	
Name:	Ort:	
Stand Ende:	Sachbear-	
	beiter/in:	
		
	Telefon:	

in Tsd E	uro
----------	-----

	in Tsd Euro			
	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
0180	1.1.2.4a	(-) Wesentliche Verluste des laufenden Geschäftsjahres, Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 3b KWG		
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	Zwischenverlust (aufsichtlich)		= 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 § 10 Abs. 3 KWG 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		
0240	1.1.2.5	(-) Nettogewinne aus der Kapitalisierung künftiger Erträge verbriefter Forderungen		§ 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	Im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften (Prudential Filters)		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)
0320	1.1.2.6.07	Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf finanzielle Verbindlichkeiten (eigenes Kreditrisiko)		
<u> </u>				Blatt 3
				Ball s

1. Übersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken,	zu den
Marktricikonocitionen und zum operationellen Piciko	

markarolikopoolilori aria zairi oporatioriori ritoliko				
Institutsnummer:	Prüfziffer:			
Name	Out			
Name:	Ort:			
o				
Stand Ende:	Sachbear- beiter/in:			
	beiter/in:			
	Talafana			
	Telefon:			

	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- Vermögensgewerten 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	Sonderposten für allgemeine Bankrisiken nach § 340g HGB		
0430	1.1.4	Andere und landesspezifische Kernkapitalbestandteile		=1.1.4.1a+1.1.4.3+1.1.4.4
0451	1.1.4.1a	Sonstiges Kapital		=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
M	arktrisikopositionen und zum operationellen Risiko	

wai ku isikoposi	wai ku isikopositionen unu zum operationenen riisiko		
Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Name:		Ort:	
Stand Ende:		Sachbear-	
		beiter/in:	
		Telefon:	

	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
	ID	Dezeicillidilg	(a)	Kommentare
				00
0456	1.1.4.1a.05	Begrenzt anrechenbare, einer Übergangsvorschrift unterliegende Kernkapitalinstrumente, befristet oder mit Tilgungsanreizen	01	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	Korrekturposten (positiv) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften		
0470	1.1.4.4	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		
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

ıvıaı ku isikupusi	warktrisikopositionen unu zum operationenen nisiko			
Institutsnummer:		Prüfziffer:		
Name:		Ort:		
Stand Ende:		Sachbear-		
		beiter/in:		
		Telefon:		

Column		ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
1.1.5.4.2 (-) Emhahmen der Kredite an Gesellschafter, sowie der Überschuss der Aktivposten bei Zweigstellen von Unternehmen mit Sitz im Ausland 1.2.1 1.2.2+1.2.3 1.2.1.1+1.2.1.2+1.2.3 1.2.1.1 1.2.1.2+1.2.3 1.2.1.1 1.2.1.2+1.2.1.3+1.2.1.4+1.2.1.5+1.2.1.5+1.2.1.5+1.2.1.5 1.2.1.1 Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestandteile anrechenbare Kernkapitalbestandteile anrechenbare Kernkapitalbestandteile (siehe Position 051 i0.01) 1.1.5.2 a 1.2.1.2 Korrekturposten für aus dem Kernkapitalbestandteile Bewertungseffekte Position 051 i0.01) 1.1.5.2 a 1.2.1.2.0 Korrekturposten für aus dem Kernkapitalbestandteile Pudential Filters) 1.2.1.2.0 Korrekturposten für Bewertungsfekte aus Avalisible for Sale-Vermögenswierten für Bewertungsfekte aus Avalisible for Sale-Vermögenswierten für Bewertungsfekte aus Salesigen Avalisible for Sale-Vermögenswierten für Bewertungsfelkete aus seinstigen Avalisible for Sale-Vermögenswierten für Bewertungsfelkete aus sebst genutzten Grundstücken und Gebäuden der Grundstücken und Gebäuden der Sale-Vermögenswierten für aus en Bewertungsfelkete aus sebst genutzten Grundstücken und Gebäuden der Gebäuden de				(a)	
Gesellschafter, sowie der Überschuss der Aktivposten über die Passkyposten bei Zweigstellen von Unternehmen mit Sitz im Ausland 1.2. Ergänzungskapital = 1.2.1+1.2.2+1.2.3 = 1.2.1+1.2.1.5+1.2.1.5+1.2.1.6+1.2.1.				01	02
1.2.1+1.2.2+1.2.3 Ergänzungskapital 1. Klasse 1.2.1+1.2.1-2.1.2+1.2.1.3+1.2.1.4+1.2.1.5+1.2.1.6+1.2.1. 1.2.1+1.2.1.2.1.2 1.2.1.2+1.2.1.3+1.2.1.4+1.2.1.5+1.2.1.6+1.2.1. 1.2.1.1.2.1.3 Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestandtelle Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestandtelle Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestandtelle Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapital übertragene Rewertungseffekte (Prudential Filters) Pewertungseffekte Pewertungseffekte Pewertungseffekte Savavallable for Sale-Eigenkapitalinstrumenten Eigenkapitalinstrumenten Eigenkapita	0540	1.1.5.4.2	Gesellschafter, sowie der Überschuss der Aktivposten über die Passivposten bei Zweigstellen von Unternehmen mit		Abzugsposten nach § 10 Abs. 2a Satz 2 Nr. 4 und 5 KWG
1.2.1.1 Ergänzungskapital 1. Klasse 1.2.1.1+1.2.1.2+1.2.1.2+1.2.1.5+1.2.1.5+1.2.1.6+1.2.1.6 1.2.1.8 1.2.1.1 Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestandteile Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestragene Severtungsetfekte	0550	1.2	Ergänzungskapital		=1.2.1+1.2.2+1.2.3
anrechenbare Kernkapitalbestandteile Kernkapitalbestandteile gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 7 (siehe Position 0511/01) 1.2.1.2 Korrekturposten für aus dem Kernkapital übertragene Bewertungseffekte (Prudential Filters) Soso 1.2.1.2.01 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten Soso 1.2.1.2.02 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögenswerten Vermögenswerten Soso 1.2.1.2.03 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzirvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden Soso 1.2.1.2.04 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzirvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden Soso 1.2.1.2.05 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sebst genutzen Grundstücken und Gebäuden Soso 1.2.1.2.05 Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücksigen betreffen Soso 1.2.1.2.05 Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücksigen betreffen Soso 1.2.1.3 Nicht realisierte Reserven in Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden sowie in notierten Wertpapieren, in Verbundunternehmen und Investmentantellen Soso 1.2.1.4 Freie Vorsorgereserven nach § 340f HGB Sosio 1.2.1.5 Rücklagen nach § 6b des ESTG aus der Veräußerung von Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden Soso 1.2.1.6 Kapital gemäß § 10 Abs. 5 KWG (abzüglich Marktpflegeposition) Soso 1.2.1.7 Berücksichtigungsfähiger Wertberichtigungsüberschuss für IRBA-Positionen gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 9 KWG (abzgl. eigener kumulaliver Vorzugsaktien im Sinne des § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 9 KWG (abzgl. eigener kumulaliver Vorzugsaktien)	0560	1.2.1	Ergänzungskapital 1. Klasse		=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
Kernkapital übertragene Bewertungseffekte (Prudential Filters)	0570	1.2.1.1			Kernkapitalbestandteile gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 7a KWG (siehe Position 0511/01)
aus Available for Sale- Eigenkapitalinstrumenten 1.2.1.2.02 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale- Vermögenswerten 1.2.1.2.03 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale- Vermögenswerten 1.2.1.2.04 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden 1.2.1.2.04 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden 1.2.1.2.05 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden 1.2.1.2.05 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden 1.2.1.2.05 Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen 1.2.1.3 Nicht realisierte Reserven in Grundstücken grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden sowie in notierten Wertpapieren, in Verbundunternehmen und Investmentanteilen 1.2.1.4 Freie Vorsorgereserven nach § 340f HGB 1.2.1.5 Rücklagen nach § 6b des ESTG aus der Veräußerung von Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden 1.2.1.6 Kapital gemäß § 10 Abs. 5 KWG (abzüglich Marktpflegeposition) 1.2.1.7 Berücksichtigungsfähiger Wertberichtigungsüberschuss für IRBA- Positionen gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 9 KWG 1.2.1.8 Kumulative Vorzugsaktien im Sinne des § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 2 KWG (abzguleigener kumulativer Vorzugsaktien)	0580	1.2.1.2	Kernkapital übertragene		1.2.1.2.01 bis 1.2.1.2.05
aus sonstigen Available for Sale- Vermögenswerten 1.2.1.2.03 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden 620 1.2.1.2.04 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden 630 1.2.1.2.05 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden 640 1.2.1.3 Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen 650 1.2.1.4 Freie Vorsorgereserven nach § 340f HGB 660 1.2.1.5 Rücklagen nach § 6b des ESTG aus der Veräußerung von Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden 660 1.2.1.6 Kapital gemäß § 10 Abs. 5 KWG (abzülich Markpflegeposition) 660 1.2.1.7 Berücksichtigungsfähiger Wertberichtigungsüberschuss für IRBA-Positionen gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 9 KWG (abzul. eigener kumulativer Vorzugsaktien)	0590	1.2.1.2.01	aus Available for Sale-		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.02 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben
aus als Finanzinvestitionen gehaltenen Grundstücken und Gebäuden 1.2.1.2.04 Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden 1.2.1.2.05 Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen 0640 1.2.1.3 Nicht realisierte Reserven in Grundstücken, grundstücken und Investmentantellen 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, grundstücken, grundstücken, grundstücken, grundstücken, grundstücken, grundstücken, grundstücken, grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden 0670 1.2.1.6 Kapital gemäß § 10 Abs. 5 KWG (abzüglich Marktpflegeposition) 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 (abzg). eigener kumulativer Vorzugsaktien)	0600	1.2.1.2.02	aus sonstigen Available for Sale-		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.06 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben
aus selbst genutzten Grundstücken und Gebäuden 1.2.1.2.05 Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen 1.2.1.3 Nicht realisierte Reserven in Grundstücken, grundstücken, grundstücken, in Verbundunternehmen und Investmentanteilen 1.2.1.4 Freie Vorsorgereserven nach § 340f HGB 1.2.1.5 Rücklagen nach § 6b des ESTG aus der Veräußerung von Grundstücken, g	0610	1.2.1.2.03	aus als Finanzinvestitionen gehaltenen		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.12 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben.
Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen Nicht realisierte Reserven in Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden sowie in notierten Wertpapieren, in Verbundunternehmen und Investmentanteilen 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 Gebäuden 0670 1.2.1.6 Kapital gemäß § 10 Abs. 5 KWG (abzüglich Marktpflegeposition) 0680 1.2.1.7 Berücksichtigungsfähiger Wertberichtigungsgüberschuss 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)	0620	1.2.1.2.04	aus selbst genutzten Grundstücken und		= 45% der Bewertungsgewinne, die über Position 1.1.2.6.14 im Kernkapital unberücksichtigt bleiben
Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden sowie in notierten Wertpapieren, in Verbundunternehmen und Investmentanteilen 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 Gebäuden 0670 1.2.1.6 Kapital gemäß § 10 Abs. 5 KWG (abzüglich Marktpflegeposition) 0680 1.2.1.7 Berücksichtigungsfähiger Wertberichtigungsfähiger 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)	0630	1.2.1.2.05	Bewertungseffekte, die die sonstigen		= x% von Position 1.1.2.6.16
HGB 1.2.1.5 Rücklagen nach § 6b des ESTG aus der Veräußerung von Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden 1.2.1.6 Kapital gemäß § 10 Abs. 5 KWG (abzüglich Marktpflegeposition) 1.2.1.7 Berücksichtigungsfähiger Wertberichtigungsüberschuss für IRBA-Positionen gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 9 KWG 1.2.1.8 Kumulative Vorzugsaktien im Sinne des § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 2 KWG (abzgl. eigener kumulativer Vorzugsaktien)	0640	1.2.1.3	Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden sowie in notierten Wertpapieren, in Verbundunternehmen und		
Veräußerung von Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden 1.2.1.6 Kapital gemäß § 10 Abs. 5 KWG (abzüglich Marktpflegeposition) 1.2.1.7 Berücksichtigungsfähiger Wertberichtigungsüberschuss für IRBA- Positionen gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 9 KWG 1.2.1.8 Kumulative Vorzugsaktien im Sinne des § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 2 KWG (abzgl. eigener kumulativer Vorzugsaktien)	0650	1.2.1.4			
(abzüglich Marktpflegeposition) 1.2.1.7 Berücksichtigungsfähiger Wertberichtigungsüberschuss für IRBA- Positionen gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 9 KWG 1.2.1.8 Kumulative Vorzugsaktien im Sinne des § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 2 KWG (abzgl. eigener kumulativer Vorzugsaktien)	0660	1.2.1.5	Veräußerung von Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und		
Wertberichtigungsüberschuss für IRBA- Positionen gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 9 KWG 1.2.1.8 Kumulative Vorzugsaktien im Sinne des § 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 2 KWG (abzgl. eigener kumulativer Vorzugsaktien)	0670	1.2.1.6			
§ 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 2 KWG (abzgl. eigener kumulativer Vorzugsaktien)	0680	1.2.1.7	Wertberichtigungsüberschuss für IRBA- Positionen gemäß § 10 Abs. 2b Satz 1		
0700 1.2.2 Ergänzungskapital 2. Klasse	0690	1.2.1.8	§ 10 Abs. 2b Satz 1 Nr. 2 KWG (abzgl.		
=1.2.2.1+1.2.2.2+1.2.2.3+1.2.2.4+1.2.2.5	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

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

ıvıaı ku isikupusi	warktrisikopositionen unu zum operationenen nisiko			
Institutsnummer:		Prüfziffer:		
Name:		Ort:		
<u>'</u>				
Stand Ende:		Sachbear-		
		beiter/in:		
•				
		Telefon:		

	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
0710	1,2,2,1	Haftsummenzuschlag	01	02
0710	1.2.2.1	панѕинтенгиѕстау		
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 beücksichtigende 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 Ergänzungskpaitalsaldo nach § 10 Abs. 2a Satz 2 Nr. 7 KWG ist vom Kernkaptial 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	u den
M	arktrisikopositionen und zum operationellen Risiko	

idi ku isikopositionen una zum operationen i lisiko				
Institutsnummer:	Prüfziffer:			
Name:	Ort:			
'				
Stand Ende:	Sachbear-			
	beiter/in:			
·				
	Telefon:			

in	heT	Euro
	1 3 U	Luiv

	ID	Bezeichnung	Rotrag	Kommentare
	טו	Bezeichhung	Betrag	Kommentare
			(a)	
			01	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		
0000	100	gemäß § 10 Abs. 6 Satz 1 Nr. 6 KWG		
0890	1.3.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Kern- und Ergänzungskapital		
		Von Kern- und Erganzungskapital		
0900	1.3.LE	nachrichtlich:		=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
		Haftendes Eigenkapital nach § 10 Abs. 1d		
		Satz 3 KWG (Bemessungsgrundlage für die		
		Großkreditgrenze im Anlagebuch, für		
		qualifizierte Beteiligungen außerhalb des Finanzsektors sowie für Organkredite)		
		T THAT ESCRICTS SOME THE STIGHT COME,		
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		
0000	100	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		Großkreditüberschreitungen des Anlagebuches nach § 13 oder
		Anlagebuches sowie Unterlegungsbeträge für Organkredite		§ 13a Abs. 3 KWG sowie Unterlegungsbeträge für Organkredite nach § 15 KWG
		nach § 15 KWG		indent y 10 KW d
0960	1.4	Kernkapital (gesamt) für Solvenzzwecke		=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	Ergänzungskapital (gesamt) für		=1.2+1.3.T2* Darüber hinaus sind hier die Beträge aus Pos. 1.7
		Solvenzzwecke		als Abzugspositionen zu erfassen, die mit Ergänzungskapital unterlegt werden.
0980	1.6	Genutzte, verfügbare Drittrangmittel		=1.6.1+1.6.2+1.6.3+1.6.4+1.6.5+1.6.6+1.6.7
0900	1.0	Genuizie, verrugbare Drittrangmitter		-1.0.1+1.0.2+1.0.3+1.0.4+1.0.3+1.0.0+1.0. <i>/</i>
				Blatt 8

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

Marktrisikoposi	itionen und zum operationellen Ris	SIKO	
Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Name:		Ort:	
Stand Ende:		Sachbear-	
		beiter/in:	
		Telefon:	

	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
		Bezeieimang	(a)	Kommentare
				00
0990	1.6.1	Positionen gemäß § 10 Abs. 2c Satz 1 Nr. 3 KWG	01	§ 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		Drittrangmittel + 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 Drittrangmittel		1.6.6.1
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	(-) 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 derGroßkredit- 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		
	1	1		Blatt 9

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

mai ku loikopool	donon ana zam operationem mo		
Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Name:		Ort:	
Stand Ende:		Sachbear-	
		Sachbear- beiter/in:	
·			
		Telefon:	

	in Tsd Euro			
	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
			01	02
1180	1.8.2	Bruttobetrag der längerfristigen nachrangigen Verbindlichkeiten		
	1.8.3	Mindestanfangskapital		
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. 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 Zelle010/ 22
1390	2.1.1.1a.13	kurzfristige Forderungen an Unternehmen (sind in der Forderungsklasse "Unternehmen" mit aufzuführen)		
	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

. Ubersichtsbogen zu den Eigenmitteln nach § 10 KWG, zu den Adressrisiken, zu den						
Marktrisikopositionen und zum operationellen Risiko						
Institutsnummer:	Prüfziffer:					

wai ku isikoposi	illonen una zum operationenen mis	INU	
Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Name:		Ort:	
Stand Ende:		Sachbear-	
		beiter/in:	
		Telefon:	

	ID	Donaichnung	Detres	Kommentare
	טו	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
			(a)	
			01	02
1420	2.1.1.1b	IRBA-Forderungsklassen (ohne Verbriefungen)		
1430	2.1.1.1b.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		
1440	2.1.1.1b.02	Institute		
1450	2.1.1.1b.03	Unternehmen		
	2.1.1.1b.04 2.1.1.1b.05	Mengengeschäft Reteiligungen		
	2.1.1.1b.05 2.1.1.1b.06	Beteiligungen Sonstige kreditunabhängige Aktiva		
	2.1.1.2	KSA-Verbriefungstransaktionen		Anlage 3 Nr. 17 Zelle 010/33
	2.1.1.2*	darunter: Wiederverbriefungen		Anlage 3 Nr. 17 Zelle 011/33
1500	2.1.2	Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRBA)		=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	IRB-Ansatz, wenn eigene Schätzungen		2.1.2.1.01 bis 2.1.2.1.03
		weder für die Ermittlung der		Anlage 3 Nr. 18a Zelle 010/24
		Verlustquote bei Ausfall noch für IRBA-		
		Konversionsfaktoren genutzt werden		
	2.1.2.1.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		Anlage 3 Nr. 19a Zelle 010/ 24
	2.1.2.1.02	Institute		Anlage 3 Nr. 20a Zelle 010/ 24
	2.1.2.1.03 2.1.2.2	Unternehmen IRB-Ansatz, wenn eigene Schätzungen		Anlage 3 Nr. 22a Zelle 010/ 24 2.1.2.2.01 bis 2.1.2.2.04
1330	2.1.2.2	für die Ermittlung der Verlustquote bei		Anlage 18 Zelle 010/24
		Ausfall und/oder der IRBA-		Anage to zelie o to/24
		Konversionsfaktoren genutzt werden		
1560	2.1.2.2.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		Anlage 3 Nr. 19 Zelle 010/ 24
	2.1.2.2.02	Institute		Anlage 3 Nr. 20 Zelle 010/ 24
	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	Beteiligungen		Anlage 3 Nr. 24 Zelle 010/ 13
1610	2.1.2.4	IRBA-Verbriefungspositionen		Anlage 3 Nr. 25 Zelle 010/ 39
1611	2.1.2.4*	darunter: Wiederverbriefungen		Anlage 3 Nr. 25 Zelle 011/ 39
1620	2.1.2.5	Sonstige kreditunabhängige Aktiva		keine Verknüpfung mit einem anderen Meldebogen
	2.2	Abwicklungsrisiken		2.2.1 und 2.2.2
	2.2.1	Abwicklungsrisiken im Anlagebuch		Anlage 3 Nr. 27 Zelle 011/ 03
	2.2.2	Abwicklungsrisiken im Handelsbuch		Anlage 3 Nr. 27 Zelle 070/03
1640	2.3	Eigenmittelanforderungen für Marktrisikopositionen		2.3.1 und 2.3.2
1650	2.3.1	Eigenmittelanforderungen für die		2.3.1.1 bis 2.3.1.4
		Marktrisikopositionen nach den		
		Standardverfahren		
1660	2.3.1.1	Zinsnettoposition		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	Allgemeines und besonderes Kursrisiko		Anlage 3 Nr. 32 Zellen 300/01, 400/05 und 520/03
		Zinsnettoposition		
1662	2.3.1.1.02	Besonderes Kursrisiko		Anlage 3 Nr. 68 Zelle 010/61
		Verbriefungspositionen im		
1000	001100	Handelsbuch		Aplace O Ny CO Zelle O10/45
1663	2.3.1.1.03	Besonderes Kursrisiko Correlation Trading Portfolio		Anlage 3 Nr. 69 Zelle 010/45
1670	2.3.1.2	Aktiennettoposition		Anlage 3 Nr. 33 Zelle 090/07. Darüber hinaus sind hier die
		,onocoposition		Anrechnungsbeträge nach der Delta Plus Methode oder nach
				der Szenario Matrix Methode zu erfassen
		•		Blatt 11
				Blatt

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

Institutsnummer:	Prüfziffer:	
Name:	Ort:	
	<u> </u>	
Stand Ende:	Sachbear- beiter/in:	
•		
	Telefon:	
	in Tsd Euro	

	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
		Dezeichnung	(a)	Kommentare
			01	02
1680	2.3.1.3	Währungsgesamtposition		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	Rohwarenposition		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		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		4/0.00
1810	3.1a	Gesamtkennziffer (%) vor sonstigen und übergangsweise		=1-(2 - 2.6)
1820	3.2	Eigenkapitalanforderungen Überschuss (+) / Defizit (-) der Eigenmittel		=1/ (2 - 2.6) * 8 =1-2
1830	3.2.a	Gesamtkennziffer (%)		=1/2*8
1840	3.3	Überschuss (+) / Defizit (-) der Eigen-mittel unter Berücksichtigung des SRP		
1850	3.3a	Gesamtkennziffer als Index (%) unter Berücksichtigung des SRP		
1860	3.4	Interne Einschätzung der Risikotragfähigkeit: Überschusse (+) / 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. Meld	ung über K	SA-Positio	onen ohne	Verbrief	ungsposit	ionen				KSA ES
KSA	A-Forderungsklasse:		blatt (Anlage 3 . 3 - 16)	Inst	titutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand Ende:		Sach	nbearbeiter/in:		Telefon:			
_									J		·	in Tsd Euro
		KSA-Beme (§ 49 Abs. 2 So		(-) Wertberichtigungen un	KSA-Bem	Kreditris	ikominderunç KS		mit Substitu ngsgrundlag		n bei den	KSA-Beme Kreditrisikor
		essungsgrundlage vo Kreditrisikominderur IvV) zzgl. Wertberich	Nach der Laufzeitme od	d Rückstellungen, die für die in Positionen gebildet wurden	essungsgrundlage vo Kreditrisikominderur (§ 49 Abs. 2 S	berücksi fähige Ga Kredite Inkongrue	nrleistungen chtigungs- irantien und derivate: enzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistur sowie Lebensversi	Substitutio	onseffekte	ssungsgrundlage na ninderungstechniken
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kredtrisikominderungstechniken Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	 (-) Wertberichtigungen und Rücksteillungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA- Positionen gebildet wurden 	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kredtrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherunger; inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09
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 Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensioner, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechungspositionen 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											
070 080 090 100 110	0% 10% 20% 35% 50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
140	besicherte Positionen 70%											
150	75%											
160 170	100% darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 210	150% darunter: Überfällige Positionen											
220	200% Sonstige Risikogewichte											
∠یں	Consuge markogewichile											

		2. Meldur	ng über KS	A-Positionen ohne	Verbriefu	ıngsposit	ionen					KSA ES
KS	A-Forderungsklasse:		nenblatt 3 Nr. 3 - 16)	Inst	itutsnummer:		Prüfziffer			Name:		
	Ort:			Stand Ende:		Sach	bearbeiter/in:		Telefon:			
				1					l			in Tsd Euro
		Auswir berüc	kungen auf d Bemessungs ksichtigungsf	ngstechniken mit ie Höhe der KSA- grundlage: ähige finanzielle mfassenden Methode	KSA-Bem	Adressen	ausfallrisiko	r außerbilanz positionen n en nach § 50	ach KSA-		Risiko	
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	() Betragsanpassung des Weries der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungstaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kredtrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteler KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Elgenkapitalänforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme									516 10		Übertrag ÜB Meldebogen
	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 Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechungspositionen 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											
070 080	0% 10%											
090 100	20% 35%											
110 120	50% darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
140	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145												
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%				1							

220 200% 230 Sonstige Risikogewichte

210

		3. Melo	lung über k	KSA-Posi	tionen oh	ne Verbr	iefungspo	sitionen				KSA E1 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:	Zentral	regierungen	Instit	tutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand		Sachi	pearbeiter/in:		Telefon:			
				Ende]			in Tsd Euro
		KSA-Bemessungs techniken (§ 49		(-) Wertberichtigur	KSA	Kreditrisil	kominderung KS		mit Substit Ingsgrundla		en bei den	KSA-B Kreditri
		grundlage vor Berüc Abs. 2 SolvV) zzgl. V	Nach der Laufzeitm oc	ngen und Rückstellun KSA-Positioner	-Bemessungsgrundla Kreditrisikomina (§ 49 Abs	berücksi fähige Ga Kredite Inkongrue	nrleistungen chtigungs- rantien und derivate: enzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistu sowie Lebensvers	Substitution	onseffekte	iemessungsgrundlag sikominderungstechn
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Hückstellungen	darunter: 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherunger. Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 + 10
010												
	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 Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV Derivative Adressenausfall-											
050	risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060	Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	, and the second											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145												
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
	Durch Immobilien											
190 200	besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

		3. Meldung übe	KSA-Positionen o	hne Verb	riefungsp	ositionen	l				KSA E1 Blatt 2
KS	A-Forderungsklasse:	Zentralregierung	en Insti	tutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:		Stand Ende	:	Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			
		Auswirkungen au Bemessu berücksichtigur Sicherheiten na	erungstechniken mit if die Höhe der KSA- ngsgrundlage: gsfähige finanzielle th der umfassenden ethode	KSA-	Adressen	ederung der ausfallrisiko sionsfaktore	positionen r	nach KSA-			in Tsd Euro
		Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(2) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungstaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfäktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		12 13	14	15=11+12 + 13	16	17	18	19	0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA-										Übertrag ÜB Meldebogen
020	Positionen nach Art der Position Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV										
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen										
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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										
070 080	0% 10%										
090 100	20% 35%										
110	50%										
120	darunter: Überfällige Positionen										
130 140	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen										
145	70%										
150	75%										
160 170	100% darunter: Überfällige Positionen										
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
190	Durch Immobilien besicherte Positionen										
200	150%										
210 220	darunter: Überfällige Positionen 200%										
	Sonstige Risikogewichte										

		4. Meld	ung über K	SA-Positi	onen ohne	Verbrief	ungspositi	ionen				KSA E2 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:	und örtl	lregierungen iche Gebiets- erschaften	Inst	titutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand Ende:		Sach	bearbeiter/in:		Telefon:			
		_ 7							,			in Tsd Euro
		SA-Bemessungs echniken (§ 49 ,		(-) Wertberic	KSA	Kreditrisi	kominderung KS		mit Substitu		n bei den	KSA-B Kreditris
		sgrundlage vor Berüd Abs. 2 SolvV) zzgl. W	Nach der Laufzeitm	htigungen und Rück: lemeldeten KSA-Pos	-Bemessungsgrundla Kreditrisikomind (§ 49 Abs	berücksid fähige Ga Kredite Inkongrue	nrleistungen chtigungs- rantien und derivate: enzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sowie Lebensversich	Substitution	onseffekte	emessungsgrundlag sikominderungstechn
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditriskominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions., Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechungspositionen 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											
070 080	0% 10%											
090 100	20% 35%											
110 120	50% darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
140	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
145	besicherte Positionen 70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 200	Durch Immobilien besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

		4. Meldur	ng über KS	A-Positionen ohr	e Verbrief	ungsposi	itionen					KSA E2 Blatt 2
KSA	-Forderungsklasse:	ört	gierungen und liche rperschaften	Inst	itutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort			Stand Ende:		Sachl	bearbeiter/in:		Telefon:			
		Auswirk E berück Sicherl	kungen auf die Bemessungsg ksichtigungsfä	hige finanzielle er umfassenden	KSA-B	Adressen	ederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen n	ach KSA-			in Tsd Euro
		Erhöhung der KSA-Bernes sungsgrundlage durch den Wertschwankungstaktor für Adressenausfallristkopositionen (HE) nach § 188 SolvV	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(*) Betragsampassung des Wertes der finanziellen Sichrerheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditriskominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 + 13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme									0,0 10		Übertrag ÜB Meldebogen
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen 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% 20%											
100 110	35% 50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 210	150% darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte				l l					1		

		5. Meld	ung über k	(SA-Posi	tionen oh	ne Verbr	iefungspo	sitionen				KSA E3 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:		e öffentliche tellen	Instit	tutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand Ende:		Sacht	earbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		KSA-Bemessungs techniken (§ 49)		(-) Wertberichtigun	KSA	Kreditrisil	kominderung KS/		mit Substit Ingsgrundla			
		grundlage vor Berüc Abs. 2 SolvV) zzgl. V	Nach der Laufzeitm oc	ıgen und Rückstellun KSA-Positioner	-Bemessungsgrundli Kreditrisikomino (§ 49 Abs	berücksi fähige Ga Kredito Inkongrue	nrleistungen chtigungs- rantien und derivate: enzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sowie Lebensversich	Substitution	onseffekte	iemessungsgrundlag sikominderungstechn
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	 (-) Wertberichtigungen und Rücksteilungen, die für die in Spalte (1) gemeideten KSA-Positionen gebildet wurden 	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditriskominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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											
	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und											
020	Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100 110	35% 50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 210	150% darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

		5. Meldu	ng über K	SA-Positionen o	hne Verb	riefungsp	ositioner	1				KSA E3 Blatt 2
KS	A-Forderungsklasse:		öffentliche ellen	Instit	tutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand Ende:		Sachh	earbeiter/in:		Telefon:			
	01.			Otaria Eriac.		Guoris	carbeitei/iii.		T CICIOII.			in Tsd Euro
		Auswirk E berück Sicherh	ungen auf di Bemessungsg sichtigungsf	ähige finanzielle er umfassenden	KSA-Be	Adressen	ederung der ausfallrisiko sionsfaktore	positionen i	nach KSA-			
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungstähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeltanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 + 13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA						"	'	"			Übertrag ÜB Meldebogen
	Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100	35% 50%											
120												
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
140	Durch Gewerbeimmobilien											
145	besicherte Positionen 70%											
150	75%											
160	100%											
180	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											·
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

		6. Meld	lung über K	(SA-Posi	tionen oh	ne Verbr	efungspo	sitionen				KSA E4 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:		tilaterale lungsbanken	Insti	tutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand		Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			
	J			Ende		Guoria	our bonon min		10,0,0,0			in Tsd Euro
		KSA-Bemessungs techniken (§ 49 /		(-) Wertberichtigun	KSA	Kreditrisik	ominderung KS		mit Substitungsgrundla		en bei den	KSA-B Kreditris
		grundlage vor Berüd Abs. 2 SolvV) zzgl. V	Nach der Laufzeitm oc	gen und Rückstellun KSA-Positioner	Bemessungsgrundla Kreditrisikomino (§ 49 Abs	berücksid fähige Ga Kredito Inkongrue	rleistungen chtigungs- rantien und lerivate: nzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistu sowie Lebensvers	Substitution	onseffekte	emessungsgrundlag ikominderungstechr
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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											
020	Position Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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	-										
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100	35%											
110 120	50% darunter: Überfällige Positionen											
	Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
140	besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
180	anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 210	150% darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

200

210

220

150%

darunter: Überfällige Positionen

200% 230 Sonstige Risikogewichte

		7. Meld	lung über k	(SA-Posi	tionen oh	ne Verbr	iefungspo	sitionen				KSA E5 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:		nationale nisationen	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand		Sachh	pearbeiter/in:		Telefon:			
	5 1			Ende:		Guoria	our bollon, iii					in Tsd Euro
		KSA-Bemessungs techniken (§ 49		(-) Wertberichtigur	KSA	Kreditrisik	kominderung KS.		mit Substiti		en bei den	KSA-E Kreditri
		sgrundlage vor Berü Abs. 2 SolvV) zzgl. v	Nach der Laufzeitm	ngen und Rückstellur KSA-Positioner	t-Bemessungsgrundl Kreditrisikomini (§ 49 Ab	berücksi fähige Ga Kredite Inkongrue	nrleistungen chtigungs- rantien und derivate: enzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistu sowie Lebensvers	Substitutio	onseffekte	3emessungsgrundlag sikominderungstechr
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundiage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100	35% 50%											
110	darunter: Überfällige Positionen											
	Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
140	besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
180	anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 210	150% darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

		7. Meldu	ng über K	SA-Positionen o	hne Verb	riefungsp	ositionen	ı				KSA E5 Blatt 2
KS	A-Forderungsklasse:		ationale sationen	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand Ende:		Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			
		Auswirk E berück	ungen auf di semessungsg sichtigungsf	ähige finanzielle		Adressen	ederung der ausfallrisiko sionsfaktore	positionen r	nach KSA-			in Tsd Euro
			eiten nach d Metho	ler umfassenden ide	KSA-Be	Konver	Sionsiartore	en nacii y 5	T SOIV V			
		Erhöhung der KSA-Bei Wertschwankungsfaktor fi (HE) na	(-) Berücksichtigungsf Schwankungs- unc	(-) B fi	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken					KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		Erhöhung der KSA-Bernessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfäktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	 (-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktionen für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente	ı Berücksichtigung aller Istechniken	0%	20%	50%	100%	h§ 48 SolvV	Positionswert)	erungen
		12	13	14	15=11+12 + 13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA-									0,5 10		Übertrag ÜB Meldebogen
	Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
070 080	0% 10%											
090 100	20% 35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 200	Durch Immobilien besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

		8. Melo	lung über l	(SA-Posi	tionen oh	ne Verbr	iefungspo	sitionen				KSA E6 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:	In	stitute	Instit	tutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand		Sachi	pearbeiter/in:		Telefon:			
	Oit.			Ende		Jacin	Jear Deiter/III.		Telefoli.			in Tsd Euro
		KSA-Bernessungs techniken (§ 49 /		(-) Wertberichtigun	KSA	Kreditrisil	kominderung KS		mit Substit Ingsgrundla		en bei den	KSA-B Kreditris
		grundlage vor Berüd Abs. 2 SolvV) zzgl. V	Nach der Laufzeitm oc	gen und Rückstellun KSA-Positioner	-Bemessungsgrundla Kreditrisikomino (§ 49 Abs	berücksi fähige Ga Kredite Inkongrue	nrleistungen chtigungs- rantien und derivate: enzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistu sowie Lebensvers	Substitution	onseffekte	emessungsgrundlag ikominderungstechn
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Markbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rücksteilungen, die für die in Spalte (1) gemeideten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV Derivative Adressenausfall-											
050	risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV Aufrechnungspositionen aus											
060	berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien											
	besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 200	Durch Immobilien besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

		8. Meldu	ng über K	SA-Positionen o	hne Verb	riefungsp	ositioner	1				KSA E6 Blatt 2
KS	A-Forderungsklasse:	Ins	titute	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	-			1		1			1			
	Ort:			Stand Ende:		Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		Kreditrisikominderungs Auswirkungen auf die H Bemessungsgru berücksichtigungsfähig Sicherheiten nach der U Methode			KSA-B	Aufgliederung der außerbilan: Adressenausfallrisikopositionen n Konversionsfaktoren nach § 50			nach KSA-			
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor 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	KSA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 + 13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme						,	,	,	-7-		Übertrag ÜB Meldebogen
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position	•										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	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											
070	Risikogewichten 0%											
080	10%											1
090 100	20% 35%											
110	50%											
120	Ohno Ponitätahaustailung ainar											
130	anerkannten Hatingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											1
160 170	100% darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 210	150% darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

	9. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen KSA E7 Blatt 1											
KS	A-Forderungsklasse:	emitti	reditinstituten erte gedeckte erschreibungen	Instit	tutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand Ende:	i.	Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			
		KSA-Bemessung techniken (§ 49			8	Kreditrisik			mit Substitu			in Tsd Euro KSA
		ısgrundlage vor Berücl Abs. 2 SolvV) zzgl. W	Nach der Laufzeitme ode	ingen und Rückstellungen, die für die ir KSA-Positionen gebildet wurden	A-Bemessungsgrundla Kreditrisikomind (§ 49 Abs	berücksic fähige Gar Kreditd Inkongrue	rleistungen chtigungs- rantien und lerivate: nzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sowie Lebensversich	Substitution	onseffekte	Bemessungsgrundlage risikominderungstechni
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kredtirisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV Derivative Adressenausfall-											
050	risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100 110	35% 50%											
120												
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien											
145	besicherte Positionen 70%											
150	75%											
160 170	100% darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210 220	darunter: Überfällige Positionen 200%											
	Sonstige Risikogewichte											

		9. Meldu	ng über KS	A-Positionen oh	ne Verbr	iefungspo	ositionen					KSA E7 Blatt 2
KS	A-Forderungsklasse:	emittiert	ditinstituten te gedeckte schreibungen		utsnummer		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand Ende:		Soobb	earbeiter/in:		Telefon:			
	Oit.			Stario Erioe.		Sacrib	earbeitei/iii.		i eleion.			in Tsd Euro
			kungen auf die Bemessungsg ksichtigungsfä	hige finanzielle er umfassenden	KSA-B	Adressen	ausfallrisiko	r außerbilar ppositionen en nach § 5	nach KSA-			
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor 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 Laufzeitanpassungsfäktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditriskominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 + 13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17-	21	22
010	Gesamtsumme									0,5*18		Übertrag ÜB Meldebogen
	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 Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV Derivative Adressenausfall-											
050	risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100 110	35% 50%											
120												
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
140	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
145	besicherte Positionen 70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien											
200	besicherte Positionen 150%											
210 220	darunter: Überfällige Positionen 200%											
	Sonstige Risikogewichte											

		10. Mel	dung über	KSA-Pos		KSA E8 Blatt 1						
KS	A-Forderungsklasse:	Unte	rnehmen	Instit	tutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:			Telefon:			in Tsd Euro
		KSA-Bemessungs techniken (§ 49 ,		(-) Wertberichtigun	KSA	Kreditrisil	kominderung KS/		mit Substit Ingsgrundla		en bei den	
		grundlage vor Berüd Abs. 2 SolvV) zzgl. V	Nach der Laufzeitm oc	kemessungsgrundla Kreditrisikomind (§ 49 Abs en und Rückstellun KSA-Positionen	-Bemessungsgrundla Kreditrisikomino (§ 49 Abs	Als Gewährleistunger berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sowie Lebensversich	Substitution	onseffekte	iemessungsgrundlag sikominderungstechn
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditriskominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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											
020	Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100 110	35% 50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 210	150% darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

10. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen											KSA E8 Blatt 2	
KS	A-Forderungsklasse:	Unter	nehmen	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
				1		1			1			
	Ort			Stand Ende:		Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		Auswirk E berück Sicherh	ungen auf di Bemessungsg sichtigungsf	ähige finanzielle er umfassenden	KSA-B	Adressen	ederung der ausfallrisiko sionsfaktore	positionen r	nach KSA-			
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor 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	KSA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		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 ÜB Meldebogen
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	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											
070	Risikogewichten 0%											
080	10%											
090 100	20% 35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien											
	besicherte Positionen											
145	70% 75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 200	Durch Immobilien besicherte Positionen 150%											
210												
220	200% Sonstige Risikogewichte											
230	consuge markogewichte				I .							1

		11. Mel	dung über l	KSA-Posit	tionen ohn	e Verbrie	efungsposi	itionen				KSA E9 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:	Menge	engeschäft	Inst	titutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand		Saci	hbearbeiter/in:		Telefon:			
				Ende:					J			in Tsd Euro
		(SA-Bemessungs techniken (§ 49 A		(-) Wertberic	KSA-	Kreditris	ikominderunç KS	gstechniken A-Bemessu			n bei den	KSA-Be Kreditris
		grundlage vor Berü \bs. 2 SolvV) zzgl. V	Vach der Laufzeitmei ode rundlage vor Berück		emessungsgrundla Kreditrisikomind (§ 49 Abs	berücksi fähige Ga Krediti Inkongrue	hrleistungen ichtigungs- arantien und derivate: enzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sowie Lebensversich	Substitutio	onseffekte	emessungsgrundlag ikominderungstechr
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spatte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Krediffisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kredtinsikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Sicherheitennachschüssen sowie sonstilge Pensions-, Darlehens- sund vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechungspositionen 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	_										
070 080	0% 10%											
090	20% 35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
140	besicherte Positionen											
145	70% 75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210 220	darunter: Überfällige Positionen 200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

33

11. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen KSA E												KSA E9 Blatt 2
KSA	-Forderungsklasse:	Menger	ngeschäft	Inst	itutsnummer:	Prüfziffer:		Name:				
	Ort:			Stand Ende:		Sach	bearbeiter/in:		Telefon:			
												in Tsd Euro
		Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA- Bernessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode			KSA-B	Aufgliederung der außerbilanzi Adressenausfallrisikopositionen na Konversionsfaktoren nach § 50			ach KSA-			
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungstäktor für Adressenausfalfrisikopositionen (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	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteler KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 + 13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17-	21	22
010	Gesamtsumme									0,5*18		Übertrag ÜB Meldebogen
	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 Sicherheitennachschüssen 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%											
080 090	10% 20%											
100 110	35% 50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 210	150% darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

Continuation Cont	en bei den	uro KSA-Bemessu KSA-Bemessu Kreditrisikomino
Ende: Sacribearbeite/iii.	en bei den	
KSA-Bemassungsgrundlagen KSA-Bemassungsgrundlagen	en bei den	
ichtigung (S 49 As	onseffekte	messu
Als Gewährleistungs- sowie Lebensversich Berücksichtigungs- finanzzielle Sicheheiten Kreditderivate: Inkongruenzenberei- nigte Beträge KSA-Positionen ge KSA		ngsgrundlage lerungstechn
(-) Gesamtisumme der Abgänge Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Berücksichtigungsichtigungstähige Ginanzielle Sicherheiten Kreditrisisikominderungsberücksichtigung und fähige Gaarantien KSA-Bennessungsgrundlage vor Berücksichtigung von KGA-Positionen gebildet wurden KSA-Positionen gebildet wurden KSA-Positionen gebildet wurden KSA-Positionen gebildet wurden KSA-Bennessungsgrundlage vor Berücksichtigung von KSA-Positionen gebildet wurden	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kredtrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
01 02 03 04=01+03 05 06 07 08 09=05+ 06+07+08	10 11	1=04+09 + 10
010 Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA-		
Positionen nach Art der Position		
Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und		
S 12 Abs. 2 SolvV		
Außerbilanzielle 030 Adressenausfall- risikopositionen		
Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV		
Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV		
Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen 060 produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV		
Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten		
070 0%		
080		
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 2	
KS	A-Forderungsklasse:		nmobilien Positionen	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort			Stand Ende:		Soobb	earbeiter/in:		Telefon:			
	Off			Stand Ende:		Sacrib	earbeilei/in:		releion:			in Tsd Euro
		Auswirk E berück Sicherh	ungen auf di semessungsg sichtigungsf	ähige finanzielle ler umfassenden	KSA-B	Adressen	ederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen i	nach KSA-			
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(*) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfaktore für berücksichtigungsfaktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		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 ÜB Meldebogen
	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 Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080	10%											
090 100	20% 35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien											
	besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 200	Durch Immobilien besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte				I							1

		13. Mel	dung über	KSA-Pos	sitionen o	hne Verb	riefungsp	ositioner	1			KSA E11 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:	Investr	mentanteile	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand		Sacht	earbeiter/in:		Telefon:			
	Ort.			Ende:		Oddill	carbeitei/iii.		T CICION.			in Tsd Euro
		KSA-Bemessungs techniken (§ 49)		(-) Wertberichtigur	KSA	Kreditrisik	kominderung KS/		mit Substiti		en bei den	KSA-B Kreditri
		grundlage vor Berüc Abs. 2 SolvV) zzgl. V	Nach der Laufzeitm oc	ngen und Rückstellun KSA-Positioner	-Bemessungsgrundli Kreditrisikomino (§ 49 Abs	berücksi fähige Ga Kredito Inkongrue	nrleistungen chtigungs- rantien und derivate: enzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sowie Lebensversich	Substitution	onseffekte	emessungsgrundlag sikominderungstechr
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	 (-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spatte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden 	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche Ansprüche sowie Lebensversicherungen. Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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											
020	Position Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100	35%											
110	50%											
	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
180	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

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

		13. Meld	ung über l	(SA-Positionen	ohne Ver	briefungs	positione	en				KSA E11 Blatt 2
KS	A-Forderungsklasse:	Investm	entanteile	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
				1		1			1			
	Ort			Stand Ende:		Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		Auswirk E berück	ungen auf di Bemessungso sichtigungsf	ähige finanzielle ler umfassenden	KSA-E	Adressen	ederung der ausfallrisiko sionsfaktore	positionen i	nach KSA-			
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfäktor für Adressenausfällrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(*) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfaktore nud Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		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 ÜB Meldebogen
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position	•										
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	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											
070												
080 090												
100	35%											
110												
120	Ohna Ranitätahaurtailung ainar											
130	anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150 160												
170												
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	besicherte Positionen											
200 210												
220												
∠30	Sonstige Risikogewichte											1

		14. Mel	dung über	KSA-Pos	sitionen o	hne Verb	riefungsp	ositioner	1			KSA E12 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:	Betei	iligungen	Instit	tutsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand Ende:		Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			
		_							1			in Tsd Euro
		KSA-Bemessungs techniken (§ 49		;-) Wertberichtigur	KSA	Kreditrisik			mit Substiti		en bei den	KSA-E Kreditri
		ıgrundlage vor Berü Abs. 2 SolvV) zzgl. V	Nach der Laufzeitm o	ngen und Rückstellur KSA-Positioner	r-Bemessungsgrundl Kreditrisikomin (§ 49 Ab	berücksid fähige Gar Kreditd Inkongrue	rleistungen chtigungs- rantien und erivate: nzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleist sowie Lebensver	Substitutio	onseffekte	temessungsgrundlag sikominderungstech
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	 (-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden 	KSA-Bemessungsgrundiage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kredtirisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100	35%											
110 120	50% darunter: Überfällige Positionen											
	Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
140	besicherte Positionen											
145												
150 160	75% 100%											
170 180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
100	anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 210	150% darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

		14. Meld	ung über k	KSA-Positionen	ohne Ver	briefungs	positione	en				KSA E12 Blatt 2
KS	A-Forderungsklasse:	Beteil	igungen	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
				1		1 .]			
	Ort:			Stand Ende:		Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		Kreditri	sikominderur	ngstechniken mit								III ISG EUIO
		Auswirk E berück Sicherh	ungen auf di Bemessungsg sichtigungsf	e Höhe der KSA- grundlage: ähige finanzielle ler umfassenden	KSA-Be	Adressen	ederung de ausfallrisiko sionsfaktor	positionen i	nach KSA-			
		Erhöhung der KSA-Bernessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfäktor für Adressenausfallirisikopositionen (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	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		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 ÜB Meldebogen
	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 Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080	10%											
090 100	20% 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 Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
190	anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien											
200	besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

		15. Mel	dung über	KSA-Pos	itionen o	hne Verb	riefungsp	ositioner	1			KSA E13 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:	sonstig	e Positionen	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand		Sachi	pearbeiter/in:		Telefon:			
	J			Ende:		Guoria	our bollon, iii		10.0.01.			in Tsd Euro
		KSA-Bemessungs techniken (§ 49		(-) Wertberichtigur	KSA	Kreditrisik	kominderung KS.		mit Substiti ngsgrundla		en bei den	KSA-E Kreditri
		sgrundlage vor Berü Abs. 2 SolvV) zzgl. V	Nach der Laufzeitm	ngen und Rückstellur KSA-Positioner	\-Bemessungsgrundl Kreditrisikomin (§ 49 Ab	berücksi fähige Ga Kredite Inkongrue	nrleistungen chtigungs- rantien und derivate: enzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistu sowie Lebensvers	Substitution	onseffekte	3emessungsgrundlag sikominderungstechr
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145												
150	75%											
160 170	100% darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210 220	darunter: Überfällige Positionen 200%											
230												

		15. Meld	ung über l	(SA-Positionen	ohne Ver	briefungs	positione	en				KSA E13 Blatt 2
KS.	A-Forderungsklasse:	sonstige	Positionen	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
				1		1 .			Ì			
	Ort:			Stand Ende:		Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		Kreditris	sikominderur	ngstechniken mit								In 18d Euro
		berück Sicherh	sichtigungsf	ähige finanzielle er umfassenden	KSA-Be	Adressen	ederung der ausfallrisiko sionsfaktore	positionen i	nach KSA-			
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallirisikopositionen (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	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		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 ÜB Meldebogen
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	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											
070	Risikogewichten 0%											
080	10%											1
090 100	20% 35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien											
	besicherte Positionen											
145												
150 160	75% 100%											
170	, and the second											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190 200	Durch Immobilien besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

		16. Mel	dung über	KSA-Pos	sitionen o	hne Verb	riefungsp	ositioner	1			KSA E14 Blatt 1
KS	A-Forderungsklasse:		erfällige sitionen	Instit	utsnummer:		Prüfziffer:			Name:		
	Ort:			Stand		Sachh	earbeiter/in:		Telefon:			
	5			Ende:		Oddill	our bollon in i		10.0.0			in Tsd Euro
		KSA-Bemessungs techniken (§ 49)		(-) Wertberichtigun	KSA	Kreditrisik	kominderung KS		mit Substitungsgrundla		en bei den	KSA-B Kreditris
		grundlage vor Berüc Abs. 2 SolvV) zzgl. V	Nach der Laufzeitm oc	ngen und Rückstellun KSA-Positioner	-Bemessungsgrundli Kreditrisikomino (§ 49 Abs	berücksi fähige Ga Kredito Inkongrue	nrleistungen chtigungs- rantien und derivate: enzenberei- Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sowie Lebensversich	Substitution	onseffekte	emessungsgrundlag sikominderungstechr
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungs- techniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	 (-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spatte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden 	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche Ansprüche sowie Lebensversicherungen. Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseflekten
		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											
020	Position Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080 090	10% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145												
150	75%											
160	100%											
180	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien											
200	besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

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

		16. Meld	ung über l	(SA-Positionen	ohne Ver	briefungs	positione	n				KSA E14 Blatt 2
KS.	A-Forderungsklasse:	überfällige	Positionen	Instit	tutsnummer		Prüfziffer:			Name:		
	-			1		1			1			
	Ort:			Stand Ende:		Sachb	earbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		Auswirk E berück	ungen auf di semessungsg sichtigungsf	ähige finanzielle er umfassenden	KSA-B	Adressen	ederung der ausfallrisiko sionsfaktore	positionen r	nach KSA-			
		Ethöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(*) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfahige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 24 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen
		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 ÜB Meldebogen
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	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											
070	Risikogewichten											
080	10%											
090 100												
110												
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150												
160 170												
180	Ohna Banitätahaurtailung ainar											
190	Desicnerte Positionen											
210												
220												1
230	Sonstige Risikogewichte											

KSA EV Blatt 1 Prüfziffe KSA-Forderungsklasse: Verbriefungen Institutsnummer: Name: Verbriefungsart: Summenblatt Ort Stand Ende: Sachbearbeiter/in: Telefon: in Tsd Euro Verbriefungs-positionen Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten auf die KSA-Bemessungsgrundlage Synthetische Verbriefung: Auf das verbriefte Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechniken Wertberichtigungen gemeldeten KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung Kreditrisikominderungstechniken (§ 238 SolvV) Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositionen **①** KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken und zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen (-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsbereinigte Beträge Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten sowie als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzenbereinigte Beträge Substitutions-Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge effekte durch Anwendung von Abgänge insgesami n und Rückstellungen, die für die in Spalte KSA-Positionen gebildet wurden Nominalbetrag zurückbehaltener oder zurückerworbener Kreditbesicherung Kreditrisikominderungs-echniken auf die KSA-Bemessungsgrundlage Um Währungsinkongruet, bereinigte berücksichtigungstähig Garantien und Kreditderivate Zuflüsse Abgänge insgesamt insgesamt γon 5 (a) 02 03 06 09 010 Gesamtsumme darunter: Wiederverbriefungspositionen Originator: Gesamtengage 030 ausfallrisikopositionen Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen 031 032 Wiederverbriefungspositionen Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen 07 072 Wiederverbriefungspositionen 080 Vorzeitige Tilgung 090 Investor: Gesamtengagement darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist 091 Bilanzielle Adressen-ausfallrisikopositionen 100 Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen 101 102 Wiederverbriefungspositionen Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen 14 142 Wiederverbriefungspositionen 150 Sponsor: Gesamtengagement 160 ausfallrisikopositionen Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-170

17. Meldung über KSA-Positionen

(a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige

		17. Mel	dung übe	r KSA-F	Position	en					KSA EV Blatt 2
KSA	-Forderungsklasse:	Verbri	efungen	Institut	snummer:		Prüf- ziffer:			Name:	Diatt 2
Verb	oriefungsart:		nenblatt	Stand		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:		,
			r. ·	Ende:							in Tsd Euro
		KSA-Ben Kreditrisikom	.) Kreditrisikomino berücksichtigungs	KSA-Bemessur	Bemess (14) von	ufgliederur sungsgrun außerbilar KSA-Konv	idlage aus nziellen P	Spalte ositionen			
		KSA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	(-) Kreditrisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungstechniken	0%	%00=> 0% und %0	%00=> bun %00>	>50% und <=100%	KSA-Positionswert (§ 239 SolvV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 267 SolvV)	KSA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugspositionen
		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 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-										

17. Meldung über KSA-Positionen KSA EV Blatt 3 Instituts-Prüf-KSA-Forderungsklasse: Verbriefungen Name nummer Verbriefungsart: Summenblatt Ort: Telefon: in Tsd Euro Zuschlag zum risikogewichteten KSA-Positionswert (§ 240 SolVV) bei Verstoß gegen die Sorgialtsprlichen nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG) Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten KSA-Positionswert Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen Aufgliederung der KSA-Positionswerte nach Risikogewichten Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen Nachrichtlich: apitalanforderung entsprechend dem Abgang von KSA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 240 SolvV) Aggregierte Kapitalanforderungen Mit Rating (Bonitätsstufe 1 bis 4) 1250% Durchschai darunter: Zweitverlust-positionen in ABCP Ħ 100% 225% 350% 650% 20% 40% 50% t Rating Rating tzur 37 38 29 30 33 36 23 24 25 26 27 28 31 Übertrag ÜB 010 Gesamtsumme darunter: Wiederverbriefungspositionen Übertrag ÜB Meldebogen 020 Originator: Gesamtengagemen Bilanzielle Adressen-030 ausfallrisikopositionen Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen 031 032 Wiederverbriefungspositionen Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen 071 072 Wiederverbriefungspositionen 080 Vorzeitige Tilgung 090 Investor: Gesamtengagement darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist 091 Bilanzielle Adressen-ausfallrisikopositionen 100 Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen 101 102 Wiederverbriefungspositionen Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen 141 142 Wiederverbriefungspositionen 150 Sponsor: Gesamtengagement 160 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen

		18. Meldu	ng über	IRBA-Pos	sitionen								IRBA ES
IRB	A-Forderungsklasse:	Su (Anlage 3	mmenbla Nr. 19, 2			Institutsn	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja Ort:			Stand		Sachhaa	rbeiter/in:		Telefon:			
		Oit.			Ende:					Telefori.			in Tsd Euro
		Interne	IRBA- Kr		S	reditrisikom Substitutions Bemes	inderungst seffekten b sungsgrun	ei den IRBA	iit \-	IRBA-B Kreditris			
		Internes Ratingsystem	Bemessungsgrundlagi editrisikominderungst		berücksic fähige Gar	hrleistung htigungs- antien und lerivate	Als Gewährleistung bر	Substitutio	onseffekte	lemessungsgrundlage sikominderungstechnik		IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	t nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 + 08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme												
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aufgliederur	ng sämtli	cher IRBA-Pe	ositionen na	ich Art der F	Position						
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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												
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1	Aufgliederun	g sämtlic	her IRBA-Po	sitionen, di	e einer Ratir	ngstufe ode	r einem Ris	ikopool zug	eordnet sin	d		
090	2									_			
100	3												
120	5												
130	6	5											
140 150	, E	3											
160	9												
170 180	10												
190	12	2											
200	13												
220	15	i											
230 240	16												
250	18												
260	19												
270	<u> </u>	1											Blatt 1

		18. Meldu	ng übeı	IRBA-Po	sitionen								IRBA ES
IRB	A-Forderungsklasse:	Su (Anlage 3	mmenbl			Institutsr	nummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Ja	NI. 19, 2	.0, 21, 22)	J				J				
	Konversionsfaktoren:	Ort:			Stand Ende:		Sachbea	ırbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
						reditrisikom	ninderungst	techniken m	nit				III ISG LUIO
		Internes	IRBA-I			Substitutions		ei den IRBA		IRBA-B Kreditris			
		Internes Ratingsystem	3emessungsgrundlag editrisikominderungst		berücksic fähige Gar	hrleistung htigungs- antien und lerivate	Als Gewährleistung b	Substitution	onseffekte	emessungsgrundlage ikominderungstechnil		IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	t nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 + 08	10	11	12
280 290 300 310 320	22 23												
330	26												
340	27 28												
360	29	,											
370	30 31												
390	32												
400	33												
420	35												
430													
450	38												
460	39												
480	40 1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederun berücksichti			sitionen, di	e Spezialfin	anzierunge	n sind und n	ach § 97 Sc	olvV mit dem	n einfachen	Risikogewi	cht
490	0%		J										
500													
510	darunter: mit einer Bestlaufzeit von			-									
520	weniger als 2,5 Jahren												
530													
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 Riskogewicht 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

		18. Meld	ung über	IRBA-Position	en										IRB	A ES
IRB	A-Forderungsklasse:	(Anla	Summer age 3 Nr. 19	nblatt 9, 20, 21, 22)		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja Ort:			Stand		Sachbe	arbeiter/in:		Telefon:]	•	:- T-	J. F	
					Ende:				Double	Į.					d Euro	
		Kreditri	sikominden A	ungstechniken, die usfall auswirken (o	sich auf die hne Double	prognostiz Default Eff	ekte)	tquote bei	Default Effekte	Posi	Positi				chricht Angab	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio fähige Gar	ng eigener ngen der luote bei ill: Als leistung chtigungs- antien und lerivate		ücksichtigun	ngsfähige S	icherheiten		Berücksichtigun	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwarte (§	(-) Wertberichtig	Anzahl
				Schä bei A berück	B		berücksichti IBA-Sicherh	igungsfähige eiten	ysfähig	hschn ei Aus	schnit	RBA-P SolvV)	nforder	te Ver	ungen	der Kr
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	ittliche prognostizierte fall (%)	tliche Laufzeit in Tagen	ositionswert	ungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB Meldebogen			
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positions	en nach Art d	ler Position										
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV															
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme	Aufalieder	ıng sämtlic	her IRBA-Positione	n die einer F	Satingstufe	oder einem	Risikopool zu	geordnet	sind						
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1	gnouoi	g		, === 0.1101 1	gotuit	22. 3									
090 100	2															
110	4	Ĺ														
120 130	5	5														
140 150	7 8															
160	9															
170 180	10															
190	12															
200 210	13 14															
220 230	15 16															
240	17	,														
250 260	18															
270	20														Blatt 3	

		18. Meld	ung über	IRBA-Position	en										IKB	A ES
IRR	A-Forderungsklasse:		Summer			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			1
	Eigene Schätzungen von	(Anla	age 3 Nr. 19	9, 20, 21, 22)		iiiotituto	naminer.			T Tuiziner.			rvanic.			
	Verlustquote bei Ausfall (LGD)	Ja														
	und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	- Gu														
	MONTO SIGNATURE II.	Ort:			Stand Ende:		Sachbe	arbeiter/in:		Telefon:				in To	d Euro	
					Line.							<u> </u>		III IS	u Luio	
		Kreditri		ungstechniken, die				tquote bei	Double Default	-	P				chricht	
			А	usfall auswirken (o	nne Double	Default Eff	ekte)		Effekte	osit	ositic			4	Angabe	en
			ng eigener ngen der							ions	msw					
		Verlusto	uote bei						œ	verto	ertge	Risil			~	
			all: Als rleistung	Beri	ücksichtigur	ngsfähige S	icherheiten		erücl	jewic Verl	wich	oge	Eige) We	
			chtigungs- rantien und						ksich	:htet	ıtete	wicht	enka	т	rtber	Þ
		Kredito	derivate						Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
				Sc ber		Sonstige	berücksichti	igungsfähige	ıgsfä	chsc oei A	hsch	IRB/ Solv	ınfor	ete \ § 10	gung	l der
				Vi hätz i Aus icksi	Ben	IF	RBA-Sicherh	eiten	hige	hnitt usfa	niŧli	\-P0	deru	/erlu	en u	Krec
			∑ e	Verwendung eigener kätzungen der Verlustquatigtzungen der Verlustquatigt. Als Gewährleist ksichtigungsfähige son Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	= Gn	Berü IRB	Ber IRB/	Gev	liche II (%	che I	sition	ngen	stbe	nd R	ditne
		Garantien	Kreditderivate	ndur en de Als (jung jung jung vers	ksichtigungsf finanzielle Sicherheiten	3BA	cksi A-Se	ücks V-Sid	/ährl) proj	_auf;	ISWe		träge	ücks	hme
		ntien	eriva	ng ei er Ve Gew Sfäh ne sc ichei	gung zielle neite	fand	chtig	ichtig nerur Forde	eistu	gnos	zeit i	7		· ·	tellu	_
			क्रि	gene arlus: ährle ährle ige s wie ung	sfäh	rech	ungs	jungs ngsat erung	inge	tizie	n Ta				nger	
				gr iguot istur onsti	ige	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherungsabtretung von Forderungen	٦	te .	gen				,	
				Verwendung eigener Schätzungen der Verlustguote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen		W W	n e	ng								
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280	21															
290	22															
300 310	23 24															
320	25															
330	26															
340	27															
350 360	28															
370	30															
380	31															
390	32															
400	33															
410 420	34 35															
430	36															
440	37															
450	38															
460 470	39 40															
470	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach §															
480	97 SolvV mit dem einfachen IRBA-															
	Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positione	n, die Spezia	alfinanzieru	ngen sind ur	nd nach § 97 S	olvV mit o	lem einfach	en Risiko	gewicht	1	1		
490	0%	Jei ucksici	ıugı weraen													
500	50%															
510	70%															
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von															
530	weniger als 2,5 Jahren 90%															
540	115%															
550	250%															
	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte															
560	IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen															
300	Risikogewicht von 50%															
	berücksichtigt werden															
	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die															
E70	nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige,															
570	anderweitig nicht erfasste IRBA- Positionen, auf die ein Riskogewicht															
	angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften															
	Forderungen															

Print Prin			er IRBA-Po	ositionen								IRBA ESa		
Expansion Schalisturages von Water (200) Note	IRB	A-Forderungsklasse:					Institutsn	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
Property		Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-		., 200, 2.	<u></u>	<u>.</u>								
			Ort:					Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
1 1 1 1 1 1 1 1 1 1			=				Substitutions	seffekten b	ei den IRBA		⊼ –			
1 1 1 1 1 1 1 1 1 1			nterne	IRBA.			Bemes		dlagen		RBA-I			
1 1 1 1 1 1 1 1 1 1			s Ratingsystem	·Bemessungsgrundla reditrisikominderung		berücksic fähige Gar	htigungs- antien und	યાંક Gewährleistung k	Substitution	onseffekte	3emessungsgrundla sikominderungstech		IRBA-Positionsw	
1. Gesamtsumme			Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	ge vor Berücksichtigung von stechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	erücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge		darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	ert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
Bilanciale Adressen- Austilariski popelitionen und Auffechnungspositionen nach 4 12 Abs. 2 Solvy Austilariski popelitionen nach 4 12 Abs. 2 Solvy Austilariski popelitionen nach 4 12 Abs. 2 Solvy Austilariski popelitionen nach 4 12 Abs. 3 Solvy Austilariski popelitionen nach 5 12 Abs. 1 Solvy Austilariski popelitionen nach 9 12 Abs. 3 Solvy Auffechnungspositionen nach 9 12 Abs. 3 Solvy Auffec			01	02	03	04	05	06	07	08		10	11	12
Comparison Com	010	1. Gesamtsumme												
Auto-Characteristic Continue		Rilanzialla Adrasson	Aufgliederur	ng sämtli	cher IRBA-P	ositionen na	ich Art der F	osition						
Nichtderivative Geschäfter mit Sicherheitenrachschlüssen sowie der Verpierber oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 Softw Profitigione der Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 Softw Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 Softw Aufrechnungspositionen aus berückschlügungsfähligen berückschlügungsfähligen Auffechnungspositionen nach § 12 Abs. 4 Softw Aufzechnungspositionen aus berückschlügungsfähligen Aufzechnungspositionen aus berückschlügungsfähligen Aufzechnungspositionen aus 11 / IRBA Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind Gesamtsumme Aufgeliederung sämtlicher IRBA-Positionen,	020	ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach												
Sicherhelmane.Name.Name.Name.Name.Name.Name.Name.Nam														
State Stat	040	Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12												
National Production Product	050	ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach												
Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme	060	berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach §												
080 Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1	070	Ratingstufe oder einem Risikopool												
100			Aufgliederun	g sämtlid	her IRBA-Po	ositionen, di	e einer Ratir	ngstufe ode	r einem Ris	ikopool zug	eordnet sin	d		
110														
120 5														
130 6 6														
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														
160 9														
180 11 190 12 200 13 210 14 220 15 230 16 240 17 250 18 260 19 270 20						-								
190 12 200 13 210 14 220 15 230 16 240 17 250 18 260 19 270 20														
200 13														
220 15 230 16 240 17 250 18 260 19 270 20		13												
230 16 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20														
250 18 200 19 270 20 18 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20		16												
260 19 270 20 19 19 19 19 19 19 19 19 19 19 19 19 19														
	270	20												Right 1

		18a. Meld	ung übe	r IRBA-P	ositionen								IRBA ESa
IRB	A-Forderungsklasse:	Summent]	Institutsr	nummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Nein	a, 20a, 22	a)	J]				
	Konversionsfaktoren:	Ort:			Stand		Sachhea	ırbeiter/in:		Telefon:			
		Oit.			Ende:	reditrisikon			nit .	l eleion.			in Tsd Euro
		Interne	IRBA			Substitutions		ei den IRBA		IRBA- Kreditı			
		Internes Ratingsystem	-Bemessungsgrundla reditrisikominderung:		fähige Gar	hrleistung htigungs- antien und lerivate	Als Gewährleistung b	Substituti	onseffekte	Bemessungsgrundlag isikominderungstech		IRBA-Positionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
280													
300													
310													
320													
330													
350													
360													
380													
390	32												
400													
420													
430													
440													
460													
470	40												
480	Spezialfinanzierungen, die nach § SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederur	g sämtlic	her IRBA-Po	sitionen, di	e Spezialfin	anzierunge	n sind und r	nach § 97 Sc	olvV mit dem	einfachen	Risikogewi	cht
490	0%	berücksichti	ar weruer										
500													
510													
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
530	90%												
540 550				_									
	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 berücksichtligt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA- Positionen, auf die ein Riskogewicht angewendet wird												
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften												

(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

		18a. Mel	dung übe	r IRBA-Position	nen										INDA	A ESa
IRB	A-Forderungsklasse:	Summent		ge 3 Nr. 19a, 20a,		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von		22a))		moutato							ramo.			
	Verlustquote bei Ausfall (LGD)	Nein														
	und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:						-				_					
		Ort:			Stand Ende:		Sach	hbearbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Kraditrie	ikomindoru	ngstechniken, die s	sich auf die	prognostizi	orto Vorlust	rauoto boi Auefall	Double						chricht	licho
		reculation	ikominaciai	auswirken (oh				quote bei Ausium	Default Effekte	Po	Posi				Angabe	
			ng eigener ngen der							sitior	tions					
		Verlusto	uote bei						m	ISWe	wert	교			÷	
		Gewähr	all: Als rleistung	В	erücksichti	gungsfähige	Sicherheit	en	erüc	tgew Ve	gewi	sikog	ш) We	
		berücksic fähige Gar	chtigungs- rantien und						ksich	/ichte rlust	chtet	ewic	genk	т	rtbei	Þ
		Kredito	lerivate						tigur	te du	e du	htete (§ 8	apita	wart (ichti	nzah
				Verwendung eigener Schätzunger der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährdeistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen		Sonstige h	arücksichti	gungsfähige IRBA-	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Vertustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
				erwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Beri	oonongo z	Sicherh		nige	chnit Ausf	hnitt	Ş ₽ P	rderu	erlus Solt	en ur	Kred
		Ω.	X re	andung eigener Schätzu Verlustquote bei Ausfall Gewährleistung iksichtigungsfähige son Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	۵	D D	Si B	Gew	tliche all (%	che	sitio	ınger	≥ #bet	d Ri	itneh
		Garantien	Kreditderivate	aigen iote t ährle angs rüche ersic	ksichtigungst finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	ährle	o) pro	Lauf	nswe	,	äge	ickst	mer
		lien	rivate	er Soei A bei A sistur fähig sov	ungs elle eiten	ofano \-Sic	sich: ge IF	sichtigur IRBA- IRBSabtre	istun	gnos	zeiti	ä			ellun	
			Ψ	chätz usfal usfal ig e soi vie vie	fähig	drech	tigun 8BA- ierhe	gung &A- btreti unge	gen	tizier	n Tag				gen	
				unge II: Als	ō	ntlich	gsfäl	sfähi sfähi ung v		te	gen					
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB Meldebogen			
		Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positione	en nach Art	der Position										
020	Aufrechnungspositionen nach															
	§ 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle Adressen-															
030	austalirisikopositionen															
	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie															
040	sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über															
	Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12															
	Abs. 3 SolvV															
050	Derivative Adressen- ausfallrisikopositionen und															
030	Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV															
	Aufrechnungspositionen aus															
060	berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden															
	Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV															
	4.4 IDDA Davidianas dis sisse															
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool															
	zugeordnet sind: Gesamtsumme															
		Aufgliederu	ung sämtlici	her IRBA-Positione	n, die einer	Ratingstufe	oder einem	Risikopool zugeoro	dnet sind			1				
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1															
090																
100																
110																
130																
140	7															
150																
160 170	_															
180																
190																
200																
210 220																
230																
240																
250																
260 270	19 20															
-											1	1			Blatt 3	

	18a. Meldung über IRBA-Positionen														IRB	A ESa
IRB	A-Forderungsklasse:	Summen	blatt (Anlag 22a)	je 3 Nr. 19a, 20a,		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Nein								1		·				
	Konversionsfaktoren:	Ort:			Stand Ende:		Sach	bearbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Kreditris	ikominderur	ngstechniken, die s auswirken (oh				quote bei Ausfall	Double Default	_	ק				chricht Angab	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio fähige Gar	ng eigener ngen der quote bei all: Als deistung chtigungs- rantien und derivate				e Sicherheite	en	Effekte Berücksichtig	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Vertustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapi			
			-	Verwendur der Verlus G Berücksich Ar Lebe	Berüc	Sonstige b	perücksichtig Sicherh	gungsfähige IRBA- eiten	ıngsfähige G	durchschnittli te bei Ausfal	urchschnittlic	ter IRBA-Pos 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	tigungen und	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewählneistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	iche prognostizierte II (%)	he Laufzeit in Tagen	itionswert	ngen	beträge V)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	nehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280																
300																
320																
340 350																
360																
380																
400	33															
420	35															
440	37															
460	39															
470	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach §															
480	97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		Aufgliederi werden	ung sämtlich	ner IRBA-Positioner	n, die Spezia	alfinanzieru	ngen sind ur	nd nach § 97 SolvV	mit dem e	einfachen Ri	sikogewi	cht berü	icksichtigt	-		
490																
510																
520	weniger als 2,5 Janren															
530 540	115%															
560	250% 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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		19. Meldu	ng übei	RBA-Pos	sitionen								IRBA E1
IRB	A-Forderungsklasse:	Zentra	alregieru	ngen		Institutsn	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			Stand								
		Ort:			Ende:			rbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		n te	⋾		, K	Substitutions	inderungst effekten b sungsgrun	techniken m ei den IRBA idlagen	it -	Kre			
		Internes Ratingsystem	BA-Bemessungsgrundla Kreditrisikominderung		berücksic	hrleistung htigungs- antien und		Substitutio	onseffekte	3A-Bemessungsgrundla ditrisikominderungstech		IRBA-Positionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme	Aufgliederur	na sämtli	cher IRBA-P	ositionen na	ch Art der P	osition						
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	, and a second	.9 0										
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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												
		Aufgliederun	g sämtlic	her IRBA-Po	ositionen, di	e einer Ratir	ngstufe ode	er einem Ris	ikopool zug	eordnet sin	d		
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
100	3												
110 120	4												
130	5												
140	7												
150 160	8												
170	10												
180	11 12												
200	13												
210 220	14 15												
230	16												
240 250	17 18												
260	19												
270	20												Blatt 1

		19. Meldu	ng übei	IRBA-Po	sitionen								IRBA E1
IRB	A-Forderungsklasse:	Zentra	alregieru	ngen		Institutsr	nummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Ja			J				J				
	Konversionsfaktoren:	Ort:			Stand Ende:		Sachbea	arbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
					K	Creditrisikom							in Isa Euro
		Inter	豆		8	Substitutions Bernes	seffekten b sungsgrun		4-	IRB			
		mes F	3A-Be Kred				Als			A-Ber litrisik			
		Intemes Ratingsystem	itrisik		berücksic	hrleistung htigungs-	Gewä	Substituti	onseffekte	messu		IRBA	
		syster	ungsg			antien und Ierivate	ihrleis	Oubstituti	onsenerie	Ingsgr		-Posit	
			rundla				tung k			undla		tionsw	
		pr _ Ein	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	Mar			Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) G	Ge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	d. Adre	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	d. Adre
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	r Berü niken (darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, oder IMM berechnet (b)		_	sichtig rüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	mit Su	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	ch § 9	darunter: Außerbilanzielle Adress enausfallrisikopositionen
		Ratingstufe oder e ilkopool zugeordni nostizierte Ausfallv scheinlichkeit (%)	icksic (§ 100	darunter: nach der Laufzeitmethode, bewertungsmethod er IMM berechnet i	Garantien	Kreditderivate	gungs	tsumr	ümm	ücksi	er: Auf ausfall)9 Sol	er: Auf ausfall
		ufe od Lugeo 9 Aus: hkeit i	htigur) Solv	nach netho gsmet erech	ntien	erivat	fähige	ne dei	e der	chtigu	3erbila risiko	>	3erbila risiko
		er ein dnete allwal %)	S) von	der de, node, net (b)		σ	sons	Abgä	Zugän	ng vo	ınziell		ınziell oositic
		me بر		MS			tige	inge	ge	5 2	e men		e men
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
280 290	21 22												
300	23												
310 320	24												
330	26												
340 350													
360	29												
370 380	30												
390	32												
400	33												
420 430													
440	37												
450 460	38												
470	40												
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-												
400	Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederur berücksichti	ng sämtlic gt werde	her IRBA-Po	ositionen, di	e Spezialfin	anzierunge	n sind und r	nach § 97 Sc	olvV mit dem	n einfachen	Risikogewi	cht
490	0%												
500													
510 520	darunter: mit einer Restlaufzeit von												
530	weniger als 2,5 Jahren 90%												
540													
550	250% 1.3 Grundpfandrechtlich besicherte												
560	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 Riskogewicht angewendet wird 1.5 Veritätsrisikoposition:												
580	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

		19. Meld	lung über	IRBA-Position	en										IKB	AEI
IRB	A-Forderungsklasse:		Zentralregi	erungen		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			J								ļ			J
		Ort:			Stand Ende:		Sachbe	earbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Krediti	risikominder A	ungstechniken, die usfall auswirken (c	sich auf die hne Double	e prognosti: Default Eff	zierte Verlu fekte)	stquote bei	Double Default Effekte	Pos	Posit				chricht Angab	
		Schätzu Verlusti Ausf Gewäh berücksi fähige Ga	ung eigener ungen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate	Ber	ücksichtigur	ngsfähige S	Sicherheiten	1	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapita	Erwart ((-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzah
		G	Kre	Verwendung e der Verlustqu Gew berücksichtig Ansp Lebensv	Berücksic fir Sic	IF	RBA-Sicherl		gsfähige Gew	rchschnittliche bei Ausfall (%	chschnittliche	r IRBA-Positio t SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	lungen und Rü	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquore bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	ährleistungen	e prognostizierte 6)	Laufzeit in Tagen	nswert	n	äge	ickstellungen	mer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB Meldebogen			
		Aufgliede	rung sämtlic	her IRBA-Positione	en nach Art o	der Position	ı			'						
	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV															
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
		Aufglieder	ung sämtlicl	her IRBA-Positione	n, die einer l	Ratingstufe	oder einem	Risikopool zug	geordnet s	sind	1	1				
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1															
100																
110																
120																
140																
150	8															
170	10															
180																
200																
210																
230	16															
240	17															
250 260	18															
270	20															
															Blatt 3	

									IRB	A E1						
IRB	A-Forderungsklasse:	7	Zentralregie	erungen		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			1			L		!			I			
	INOTIVE SIGNISTANCE CIT.	Ort:			Stand Ende:		Sachbe	earbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Kreditr		ungstechniken, die usfall auswirken (o				stquote bei	Double Default		Po				chricht Angabe	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähi berücksio fähige Gai	ing eigener ingen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate				Sicherheiten		Effekte Berücksichtigu	ositionswertgewichtete i Verlustquo	sitionswertgewichtete di	Risikogewichtet (§	Eigenkapi			
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten		berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	ge Berücksichtigungsfähige Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verfustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280	21															
300	22															
310 320	24 25															
330 340	26 27															
350	28															
360 370	29 30															
380 390	31 32															
400 410	33 34															
420	35															
430 440	36 37															
450 460	38 39															
470	40															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		haviiakaiak	ung sämtlich ntigt werden	her IRBA-Positioner	n, die Spezia	alfinanzierur	ngen sind u	nd nach § 97 So	olvV mit d	em einfache	n Risikog	ewicht				
490	0%															
500 510	50% 70%															
520	darunter: mit einer Restlaufzeit vor weniger als 2,5 Jahrer															
530 540	90% 115%															
550	250%															
	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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		19a. Meld	ung übe	er IRBA-Po	ositionen								IRBA E1a
	A-Forderungsklasse:	Zentra	alregieru	ngen		Institutsr	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein] 044								
		Ort:			Stand Ende:			rbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		Int	F		K S	Substitutions	inderungst seffekten b sungsgrun	echniken m ei den IRBA dlagen	it -	ᅎᆱ			
		ernes l	RBA-B			Bomoc		diagon		BA-Be editrisil			
		Internes Ratingsystem	emessungsgrundla ditrisikominderung		berücksic	antien und	Gewährleistung b	Substitution	onseffekte	messungsgrundla xominderungstech		IRBA-Positionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme												
	Bilanzielle Adressen-	Aufgliederu	ng samtli	cher IRBA-Pe	ositionen na	ich Art der F	osition						
020	ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
030	Derivative Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
		Aufgliederun	g sämtlic	her IRBA-Po	sitionen, di	e einer Ratii	ngstufe ode	r einem Ris	ikopool zug	eordnet sin	d		
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
100	3												
110 120	5												
130 140	6												
150	8												
160 170	9 10												
180 190	11 12									_	_		
200	13												
210 220	14 15												
230 240	16 17												
250	18												
260 270	19 20												
1													Blatt 1

		19a. Meldi	ung übe	r IRBA-Po	ositionen								IRBA E1a
IRB	A-Forderungsklasse:	Zentra	alregieru	ngen		Institutsr	nummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Nein		<u>-</u>									
	Konversionsfaktoren:	Ort:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
						(reditrisikom	ninderungst	echniken m	nit]			in Isa Euro
		Inte	⋾		S	Substitutions Bemes	seffekten b sungsgrun		١-	Kre IR			
		Internes Ratingsystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)				<u>≽</u>			IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten			
		Ratin	emes			hrleistung htigungs-	s Gev			mess		IRB	
		gsyst	sung		fähige Gar	rantien und lerivate	/ährle	Substitution	onseffekte	ungs		A-Po	
		m m	sgrun		Neuro	ienvale	istun			grund		sition	
		_	dlage	Ma			Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	·		llage	⊳	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	>
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	vor E chnik	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet			icksic	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	nach en mi	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	nach	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		Ratingstufe oder e sikopool zugeordni nostizierte Ausfallv scheinlichkeit (%)	3erüc en (§	darunter: nach der Laufzeitmethode, bewertungsmethod der IMM berechne	0	Kre	htigu	amts	mtsu	Berüc t Sub	darunter: Außerbilanzielle ressenausfallrisikoposition	§ 99	darunter. Außerbilanzielle ressenausfallrisikoposition
		ngstuf ool zu zierte inlich	ksich 100	r: nac itmet ngsm n ber	Garantien	Kreditderivate	ingsfä	um m	mme	cksicl	Auße sfallri	Solv	Auße sfallri
		e ode geon Aust keit (tigun; Solv\	th de node, ethouechne	tien	rivate	ihige	der	der Z	ntigur onse	erbila sikop		erbila sikop
		er eine dnete allwar	yon	de, SI		_	sonsi	Abgä	ugän	ng vor	nzielli ositic		nzielli ositic
		7 3		≤			tige	nge	ge	ם ס	e inen		nen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
280	21												
300	22												
310	24	·											
320	25 26												
340	27												
350													
360	29												
380	31												
390 400	32												
410													
420													
440	36 37												
450	38												
460	39												
	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach §												
480	97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt												
	werden: Gesamtsumme	Aufgliederun	n sämtlia	her IRPA-D	eitionen di	e Spezialfin	anzierunga	n sind und	ach & 07 Co	lyV mit de-	einfachen	Risikogowi	cht
		berücksichti			o.c.o.ieii, ul	- opezianili	unge	oma unu n		v mit dell	. canaditell	aikogewi	n
490	0%												
500	50% 70%												
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von												
530	weniger als 2,5 Jahren 90%			1									
540													
550	250% 1.3 Grundpfandrechtlich besicherte												
560	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 Riskogewicht angewendet wird												
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften												

(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

		19a. Mel	dung übe	r IRBA-Position	en										IRB	A E1a
IRB	A-Forderungsklasse:	:	Zentralregi	erungen		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein					1									•
		Ort:			Stand Ende:		Sachbea	arbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
			Αι	ungstechniken, die s usfall auswirken (oh	sich auf die ine Double l	prognostizi Default Effe	erte Verlust kte)	quote bei	Double Default Effekte	Pos	Posit				chricht Angab	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähi berücksio fähige Gai	ng eigener ngen der quote bei all: Als deistung chtigungs- rantien und derivate	Berü	cksichtigun	gsfähige Sid	cherheiten		Berücksichtigun	itionswertgewichtete du Verlustquote	onswertgewichtete dur	Risikogewichtete (§ 8	Eigenkapita	Erwart ()	(-) Wertberichtig	Anzah
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	e IRI Grundpfandrechtliche IRBA-Sichemeiten	erücksichtigungsfähi Berücksichtigungsfähi BA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige fähige in IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Vertustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme	A. delle de		ber IDDA Desitioner		Diti							Übertrag ÜB Meldebogen			
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aufglieder	ung samtiic	her IRBA-Positioner	n nach Art d	er Position										
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV															
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme															
		Aufglieder	ung sämtlici	her IRBA-Positionen	, die einer F	Ratingstufe (oder einem	Risikopool zı	igeordnet	sind			-			
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1															
100	3															
110 120	4 5															
130	6															
140 150	7															
160	9															
170 180	10 11															
190	12															
200 210	13 14															
220	15															
230 240	16 17															
250	18															
260 270	19 20															
															Blatt 3	

		19a. Mel	dung übe	r IRBA-Position	en					_					IRB	A E1a
IRB	A-Forderungsklasse:	:	Zentralregi	erungen		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein			J					I						l
	TO THE TOTAL PROPERTY OF THE TOTAL PROPERTY	Ort:			Stand Ende:		Sachbea	arbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
			Αι	ingstechniken, die isfall auswirken (oh				quote bei	Double Default Effekte	Pos	Posit				chricht Angab	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähl berücksio fähige Gal	ing eigener ingen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate	Berü	cksichtigun	gsfähige Si	cherheiten		Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapita	Erwari ((-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzah
			<u> </u>	Verwendung der Verlust Ger berücksichti Ans Lebens	Berücks f S	IR	BA-Sicherhe		ıgsfähige Gev	ırchschnittlici bei Ausfall (chschnittlich	r IRBA-Positi 4 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	jungen und F	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzunger der Vertustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungstähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	vährleistungen	ne prognostizierte %)	e Laufzeit in Tagen	onswert	en	oträge	Rückstellungen	hmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280	21															
300	22															
310	24 25															
330 340	26 27															
350	28															
360 370	29 30															
380 390	31 32															
400	33															
410 420	34 35															
430 440	36 37															
450	38															
460 470	39 40															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
			ung sämtlich ntigt werden	ner IRBA-Positioner	ı, die Spezia	lfinanzierur	ngen sind un	d nach § 97 S	SolvV mit	dem einfac	hen Risiko	gewich	ıt			
490	0%		g. molucii													
500	50% 70%															
510 520	darunter: mit einer Restlaufzeit von															
530	weniger als 2,5 Jahren 90%															
540 550	115% 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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		20. Meldung über IRBA-Positionen											IRBA E2
IRB	A-Forderungsklasse:		Institute			Institutsn	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			1					,			
		Ort:			Stand Ende:			arbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		=	_			Creditrisikom Substitutions	effekten b	ei den IRBA		주ㅠ			
		emes	RBA-B Kre			Demes	sungsgrun <u>≯</u>	luiageri		₹BA-Be			
		Intemes Ratingsystem	emessun ditrisikom		berücksid fähige Gar	hrleistung chtigungs- rantien und	s Gewähr	Substitution	onseffekte	messung kominder		IRBA-P	
		stem	gsgrundla		Kredito	lerivate	leistung b			sgrundlag		ositionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		oder einem sordnete usfallwahr- it (%)	lung von	ch der node, nethode, SM chnet (b)	5	ate	ge sonstige	der Abgänge	er Zugänge	gung von 1seffekten	oilanzielle kopositionen		oilanzielle kopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme												
	Bilanzielle Adressen-	Aufgliederu	ng sämtli	cher IRBA-P	ositionen na	ach Art der P	osition						
020	ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie												
040	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												
		Aufgliederun	g sämtlic	her IRBA-Po	ositionen, di	e einer Ratir	gstufe ode	er einem Ris	ikopool zug	eordnet sind	i		
	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
100	3												
110	5												
130	6												
150	8												
160	9												
180	11												
200	13												
220	14												
230 240	16 17												
250 260	18 19												
270	20												Blatt 1
1													2

		20. Meldu	ng über	IRBA-Pos	sitionen								IRBA E2
IRB	A-Forderungsklasse:		Institute			Institutsn	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Ja											
	Konversionsfaktoren:	Ort:			Stand		Cookboo	rbeiter/in:		Telefon:]	
		Ort.			Ende:	un alituin ilen un			ia.	releion.			in Tsd Euro
		Intern	IRB			reditrisikom Substitutions Bemes		ei den IRBA		IRBA Kredit			
		Internes Ratingsystem	A-Bemessungsgrundk Kreditrisikominderung		berücksic	hrleistung htigungs- antien und erivate	Als Gewährleistung b	Substitutio	onseffekte	-Bemessungsgrundla risikominderungstech		IRBA-Positionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
280 290 300 310 320 330 340 350 360	22 23 24 25 26 27												
370	30												
390	32											-	
400													
410													
430	36												
440													
460	39												
470	40												
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederun berücksichti	g sämtlic	her IRBA-Po	sitionen, di	e Spezialfina	anzierunge	n sind und n	ach § 97 Sc	lvV mit dem	einfachen	Risikogewi	cht
490	0%	201 GONDIUIIII	g. werden										
500													
510													
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
530													
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 Riskogewicht 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

		20. Meld	ung über	IRBA-Position	en										IF	RBA E2
IRB	A-Forderungsklasse:		Institu	te		Institutsr	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Ja			I											
	Konversionsfaktoren:	Ort:			Stand Ende:		Sachb	earbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
			Ī	stechniken, die si auswirken (ohn				uote bei Ausfall	Double Default Effekte	Posi	Positi				chricht Angabe	
		Verlustq Ausfa Gewähr berücksic fähige Gar	ngen der Juote bei III: Als		rücksichtigu	ngsfähige \$	Sicherheite	n	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwart ()	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl
			_	Verwendun der Verlus Gu Berücksich An Leber	Berück		berücksich RBA-Sicher		gsfähige Ge	rchschnittlic bei Ausfall	chschnittlich	IRBA-Posi SolvV)	anforderun	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	ungen und	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewähnleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	ewährleistungen	che prognostizierte (%)	ne Laufzeit in Tagen	tionswert	gen	oeträge ')	Rückstellungen	nehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB Meldebogen			
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Position	en nach Art	der Positior	1									
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
			ıng sämtlici	ner IRBA-Positione	en, die einer	Ratingstufe	oder einem	n Risikopool zug	eordnet s	ind						
	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1															
100	3															
110 120	4 5															
130	6															
140 150	7 8															
160	9															
170	10															
180 190	11 12															
200 210	13 14															
220	14 15															
230 240	16 17															
250	17															
260	19															
270	20														Blatt 3	

		20. Meld								IF	RBA E2					
IRB	A-Forderungsklasse:		Institu	te		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			Stand		٦				1					
		Ort:			Ende:		Sachb	earbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Kreditrisiko	ominderung	stechniken, die si auswirken (ohn	ch auf die p e Double D	rognostizie efault Effek	rte Verlustq te)	uote bei Ausfall	Double Default Effekte	P	Pos				chricht Angabe	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähi berücksio fähige Gai	ng eigener ngen der quote bei all: Als deistung chtigungs- rantien und derivate	Ве	rücksichtigu	ungsfähige	Sicherheite	n		Positions wertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapit	Erwar	(-) Wertberichti	Anzar
				Verwendun der Verlus Gu berücksich An Leber	Berück	Sonstige	RBA-Sicher	tigungsfähige heiten	ngsfähige Ge	ırchschnittli bei Ausfall	chschnittlich	r IRBA-Posi 4 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	gungen und	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	che prognostizierte (%)	ne Laufzeit in Tagen	tionswert	gen	oeträge /)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	nehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280	21															
300	23 24															
320	25 26															
340	27															
350	28															
370	30 31															
390 400	32 33															
410	34 35															
430	36															
440	37 38															
460	39															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme	e e														
		berücksich	ung sämtlici itigt werden	her IRBA-Positione	en, die Spezi	ialfinanzierı	ungen sind u	ınd nach § 97 So	olvV mit d	em einfache	l en Risikog	ewicht				
490 500	0% 50%															
510	70% darunter: mit einer Restlaufzeit von															
520	weniger als 2,5 Jahren															
540 550	115% 250%															
	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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		20a. Meldi	ıng übe	er IRBA-Po	ositionen								IRBA E2a
IRB	A-Forderungsklasse:		Institute			Institutsr	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein]								
		Ort:			Stand Ende:			rbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		<u> </u>	_		K	Substitutions	inderungst seffekten b sungsgrun	echniken m ei den IRBA	it 	주ㅠ			
		ernes	RA-Bγ γ			Demes		diagen		IBA-Be editrisi			
		Internes Ratingsystem	emessungsgrundk ditrisikominderung		berücksic fähige Gar	hrleistung htigungs- antien und lerivate	s Gewährleistung t	Substitution	onseffekte	messungsgrundla kominderungstech		IRBA-Positionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme												
	Bilanzielle Adressen-	Aufgliederu	ng sämtli	cher IRBA-P	ositionen na	ich Art der F	osition						
020	ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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												
		Aufgliederun	g sämtlic	her IRBA-Po	ositionen, di	e einer Ratii	ngstufe ode	r einem Ris	ikopool zug	eordnet sin	d		
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1				-								
100	3												
110	4				-								
130	6												
140 150	7												
160 170	9												
180	11												
190 200	12 13												
210	14												
220 230	15 16												
240 250	17 18												
260	19												
270	20												Blatt 1

		20a. Meld	ung üb	er IRBA-Po	ositionen								IRBA E2a
IRB	A-Forderungsklasse:		Institute			Institutsn	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Nein			J				J				
	Konversionsfaktoren:	Ort:			Stand		Sachhaa	rbeiter/in:		Telefon:]	
		On.			Ende:	reditrisikom			nit .	releion.			in Tsd Euro
		<u> </u>	=			Substitutions		ei den IRBA		ᄌᇳ			
		ernes	BA-E			Demes		diagen		BA-B editris			
		Internes Ratingsystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)			hrleistung	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche			IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten		<u> </u>	
		ngsyst	ssung		fähige Gar	htigungs- antien und	vährle	Substitution	onseffekte	sungs		3A-Pc	
		e a	sgrun		Kreditd	erivate	eistun			grund ngste		sition	
			dlage	7			g beri An	<u> </u>		dage chnik	Þ	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	Þ
		Einer Ris progr	vor E	/Jarktk od			erücksichti Ansprüche) Ges	Gesa	nach en mi	darı dress	nach	darı dress
		Ratin ikopo nostiz schei	Berück en (§	darunter: nach der Laufzeitmethode, bewertungsmethod er IMM berechnet (<u>_</u>	Kre	htigu	amtsı	mtsur	Berüc t Sub:	darunter: Außerbilanzielle ressenausfallrisikopositior	§ 99	darunter: Außerbilanzielle ressenausfallrisikoposition
		gstufe ol zug ierte /	(sichti	ter: na eitme tungs M bere	Garantien	Kreditderivate	ngsfäl	ımme	nme	ksich	Auße sfallris	SolvV	Auße
		oder geord vusfal eit (%	gung olvV)	ach de thode metho	en	ivate	nige s	der A	ler Zu	tigung onseff	rbilan ilkopc		rbilan iikopc
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	von	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)			onstig	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	ı von ekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen		darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
				3			9	ge	Ψ		en		en
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
280	21												
300	23												
310	24												
330	26												
340 350	27												
360	29												
370	30												
390	32												
400	33												
420	35												
430	36 37												
450	38												
460 470	39 40												
	1.2 Specialfinanziarungan, die nach S												
480	97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt												
	werden: Gesamtsumme	Aufgliederur	a câmtlia	hor IDBA-Da	eitionen di	o Spozialfin	nziorungo	n eind und n	ach & 07 Sc	luV mit dom	oinfachan	Dieikogowi	icht
		berücksichti			omonen, di	- opezialili	uliyel	onto ullu l		and dell	. cmachen	. nanogewi	
490 500	0% 50%												
510													
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
530	90%												
540 550	115% 250%												
	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte												
560	IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen												
	Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden												
	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die												
570	nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige,												
370	Positionen, auf die ein Riskogewicht												
	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

		20a. Melo	dung übe	r IRBA-Position	en										IRBA	A E2a
IRB.	A-Forderungsklasse:		Instit	ute		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein			Stand		1				1					1
		Ort:			Ende:		Sachbe	earbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Kreditrisiko	ominderung	stechniken, die sicl auswirken (ohne	n auf die pro Double Def	gnostizierte ault Effekte	e Verlustquo)	ote bei Ausfall	Double Default Effekte	Pos	Posit				chricht Angabe	
		Verlustq Ausfa Gewähr berücksic	ngen der luote bei ill: Als leistung chtigungs- cantien und	Berti	ücksichtigun	gsfähige Si	cherheiten		Berücksichtigun	itionswertgewichtete du Verlustquote	ionswertgewichtete dur	Risikogewichtete (§ 8-	Eigenkapita	Erwart ((-) Wertberichtig	Anzah
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungstähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche	berücksichtigungsfähi Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige fähigen IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB Meldebogen			
	Bilanzielle Adressen-	Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positioner	nach Art de	r Position										
020	ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV															
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Dariehens- 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															
		Aufgliederu	ıng sämtlicl	ner IRBA-Positionen	, die einer Ra	atingstufe o	der einem R	Risikopool zuge	eordnet si	nd						
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1															
100	3															
110 120	4 5															
130	6															
140	7															
150 160	9															
170	10															
180 190	11 12															
200	13															
210 220	14 15															
230	16															
240 250	17 18															
260	19															
270	20														Blatt 3	

		20a. Mel	dung übe	r IRBA-Positione	en					_					IRB/	A E2a
IRB	A-Forderungsklasse:		Instit	ute		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein			J											
	INDITIVE SIONSTANDI ETT.	Ort:			Stand Ende:		Sachbe	earbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Kreditrisik	ominderung	stechniken, die sich auswirken (ohne				ote bei Ausfall	Double Default	P	Po				chricht Angabe	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähi berücksio fähige Gai	ng eigener ngen der quote bei all: Als deistung chtigungs- rantien und derivate	Berü	ücksichtigun				Effekte Berücksichtigur	ositionswertgewichtete d Verlustquot	sitionswertgewichtete du	Risikogewichtete (§ 8	Eigenkapita			
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungstähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	ge Berücksichtigungsfähige Berücksichtigungsfähige Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verfustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Elgenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280 290	21															
300	23	3														
310 320																
330	26															
340 350	27 28															
360	29															
370	30															
380 390																
400																
410 420	34															
430	36															
440 450	37 38															
460	39															
470	40															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
			ung sämtlich itigt werden	ner IRBA-Positionen,	, die Speziali	finanzierun	gen sind und	d nach § 97 Sol	lvV mit de	m einfacher	n Risikoge	wicht				
490	0%															
500																
510 520	darunter: mit einer Restlaufzeit von	1														
530	weniger als 2,5 Jahren 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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		21. Meldu	ng übei	IRBA-Pos	sitionen								IRBA E3
IRB	A-Forderungsklasse:	Men	gengesc	häft		Institutsn	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			Stand		0.11			-			
		Ort:			Ende:			rbeiter/in: techniken m	it	Telefon:			in Tsd Euro
		Inter	IR			Substitutions		ei den IRBA		IRB Krec			
		Internes Ratingsystem	3A-Bemessungsgrundla Kreditrisikominderung		berücksic fähige Gar	hrleistung htigungs- antien und lerivate	Als Gewährleistung b	Substitutio	onseffekte	A-Bemessungsgrundla litrisikominderungstech		IRBA-Positionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme	Aufgliederur	na sämtli	cher IRRA-P	ositionen na	och Art der F	Position						
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Augicuciui	ig summ		osidonen ne	ion Air dei i	osiaon						
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												-
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
USU	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												
		Aufgliederun	g sämtlic	her IRBA-Po	sitionen, di	e einer Ratir	ngstufe ode	er einem Ris	ikopool zug	eordnet sin	d		
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
100	3												
110 120	5												
130 140	6												
150	8												
160 170	9												
180	11												
190 200	13												
210 220	14 15												
230	16												
240 250	17												
260 270	19												
2/0	1 20	1											Blatt 1

		21. Meldu	ng über	IRBA-Po	sitionen								IRBA E3
IRB	A-Forderungsklasse:	Men	gengesc	häft		Institutsr	nummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			1								
	INOTIVE SIGNISTANCIETI.	Ort:			Stand Ende:		Sachbea	arbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		=				Kreditrisikom Substitutions	seffekten b	ei den IRBA		x -			
		nternes	IRBA-			Bemes	ssungsgrun	dlagen		RBA-B			
		Internes Ratingsystem	Bemessungsgrundla editrisikominderung		berücksic fähige Gar	hrleistung chtigungs- rantien und derivate	งไร Gewährleistung b	Substituti	onseffekte	sikominderungstech		IRBA-Positionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
280 290	21												
300 310													
320	25												
330 340	26 27												
350 360	28 29												
370 380	30 31												
390	32												
400	33 34												
420 430	35 36												
440	37												
450 460	38												
470	40 1.2 Spezialfinanzierungen, die nach §												
480	97 Solul/ mit dem einfachen IDB A-												
		Aufgliederur berücksichti		her IRBA-Po	sitionen, di	e Spezialfin	anzierunge	n sind und r	nach § 97 Sc	olvV mit den	einfachen	Risikogewi	cht
490	0%												
500 510													
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
530 540	90%												
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 Riskogewicht angewendet wird												
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen						<u></u>						

(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

		21. Meld	ung über	IRBA-Positione	n										IRB	A E3
IRB	A-Forderungsklasse:		Mengenge	eschäft		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			J		1			I						I
		Ort:			Stand Ende:		Sachbe	earbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Kreditrisik	ominderung	gstechniken, die sich auswirken (ohne	h auf die pro Double Def	gnostizierte ault Effekte	e Verlustquo	ote bei Ausfall	Double Default Effekte	Pos	Posit				chricht	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio	ill: Als leistung chtigungs- rantien und	Beri	ücksichtigun	gsfähige Si	cherheiten		Berücksichtigun	itionswertgewichtete du Verlustquote	ionswertgewichtete dur	Risikogewichtete (§ 8-	Eigenkapita	Erwart ((-) Wertberichtig	Anzah
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche Sicherheiten	berücksichtigungsfähi Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	ge Berücksichtigungsfähige Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB Meldebogen			
		Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positioner	n nach Art de	r Position										
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV															
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
		Aufgliederu	ung sämtlich	ner IRBA-Positionen	, die einer Ra	atingstufe o	der einem R	lisikopool zuge	ordnet sir	nd						
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1															
100	2															
110	4															
120	5															
140	7															
150	8															
160 170	9															
180	11															
190	12															
200	13 14															
220	15															
230	16															
240 250	17 18															
250	19															
270	20															
		1													Blatt 3	

		21. Meld	ung über	IRBA-Positione	n										IRB	A E3
IRB	A-Forderungsklasse:		Mengeng	eschäft		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			J					I						
	KUIVEISIOIISIAKIOTEII.	Ort:			Stand Ende:		Sachbe	earbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Kreditrisik	cominderung	gstechniken, die sich auswirken (ohne	h auf die pro Double Def	gnostizierte ault Effekte	e Verlustque	ote bei Ausfall	Double Default Effekte	Po	Posi				chricht Angab	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähi berücksio fähige Gai	ng eigener ngen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate		ücksichtigun	gsfähige S	icherheiten		Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Vertustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapital	Erwartı (}	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl
		Ga	Kred	Verwendung eigener der Verlustquote bei Gewährleist berücksichtigungsfäl Ansprüche s Lebensversiche	Berücksic fina Sich	IF	RBA-Sicherl		gsfähige Gewä	rchschnittliche bei Ausfall (%)	chschnittliche L	IRBA-Position	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	lungen und Rü	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	erwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtreiung von Forderungen	thrleistungen	prognostizierte)	_aufzeit in Tagen	swert		äge	ckstellungen	mer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280																
300																
320	25															
330																
350																
370	30															
380																
400																
420	35															
430	36 37															
450																
470	40															
480	Spezialfinanzierungen, die nach § SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
			ung sämtlici ntigt werden	ner IRBA-Positionen,	, die Spezial	finanzierun	gen sind und	d nach § 97 Sol	vV mit de	m einfachen	Risikoge	wicht				
490	0%															
500																
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von															
530	weniger als 2,5 Jahren 90%															
540 550	115% 250%															
560	Grundpfandrechtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		22. Meldui	ng übei	RBA-Pos	sitionen								IRBA E4
IRB	A-Forderungsklasse:	Un	ternehm	en		Institutsn	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja Ort:			Stand		Saabbaa	urbeiter/in:		Telefon:			
		On:			Ende:	reditrisikom		techniken m	it	Teleron:			in Tsd Euro
		Inter	IR			Substitutions		ei den IRBA		IRB Krec			
		Internes Ratingsystem	3A-Bemessungsgrundla Kreditrisikominderung		berücksic fähige Gar	hrleistung htigungs- antien und lerivate	Als Gewährleistung b	Substitutio	onseffekte	A-Bemessungsgrundla litrisikominderungstech		IRBA-Positionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallnsikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme	Aufgliederur	na sämtli	cher IRBA-P	ositionen na	ich Art der F	osition						
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	, and a second	.g oa										
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens-und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
USU	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												
		Aufgliederun	g sämtlic	her IRBA-Po	sitionen, di	e einer Ratir	ngstufe ode	er einem Ris	ikopool zug	eordnet sin	d		
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
100	3												
110 120	4												
130 140	ξ 7												
150													
160	10												
180 190	11												
200	13												
210 220	14 15												
230	16												
240 250	17												
260 270	19												
270	20	1											Blatt 1

		22. Meldu	ng über	IRBA-Po	sitionen								IRBA E4
IRB	A-Forderungsklasse:	Un	ternehm	en		Institutsr	nummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			J				1	L			
	INDITED SIGNATURE II.	Ort:			Stand Ende:		Sachbea	arbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		=			K	reditrisikom Substitutions	ninderungs seffekten b	techniken m	nit N-				
		nterne	IRBA-			Bemes	sungsgrur	ndlagen		IRBA-E			
		Internes Ratingsystem	Bemessungsgrundla editrisikominderung		berücksion fähige Gar	hrleistung chtigungs- rantien und derivate	vls Gewährleistung t	Substitution	onseffekte	3emessungsgrundla sikominderungstech		IRBA-Positionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
280													
300													
320	25												
330													
350													
360													
380													
390 400	32												
410													
420													
440	37												
460	38												
470													
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederun berücksichti			sitionen, di	e Spezialfin	anzierunge	n sind und n	ach § 97 Sc	olvV mit dem	einfachen	Risikogewi	cht
490	0%												
500													
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von			1									
530	weniger als 2,5 Jahren			-									
540 550													
	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 Riskogewicht 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

		22. Meld	ung über	IRBA-Position	en										IRB	A E4
IRB	A-Forderungsklasse:		Unternel	nmen		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			1		-				1					
		Ort:			Stand Ende:		Sachbe	earbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
			A	rungstechniken, die usfall auswirken (d	e sich auf di ohne Double	e prognosti Default Ef	zierte Verlu fekte)	stquote bei	Double Default Effekte	Pos	Posit				chricht	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähi berücksio fähige Gai	ng eigener ngen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate		rücksichtigui	ngsfähige S	Sicherheiter	1	Berücksichtigun	itionswertgewichtete du Verlustquote	ionswertgewichtete dur	Risikogewichtetei (§ 8/	Eigenkapita	Erwarte (§	(-) Wertberichtig	Anzahl
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sichemeiten	berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	ge Berücksichtigungsfähige Berücksichtigungsfähige IRBA-Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB Meldebogen			
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Position	en nach Art o	der Position	1									
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
		Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positione	n, die einer l	Ratingstufe	oder einem	Risikopool zug	geordnet s	sind						
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1															
100	3															
110 120	4															
130	6															
140 150	7															
160	9															
170	10															
180 190	11 12															
200	13															
210 220	14 15															
230	16															
240 250	17 18															
260	19															
270	20										<u> </u>				Blatt 3	

		22. Meld	ung über	IRBA-Position	en										IRB	A E4
IRB	A-Forderungsklasse:		Unternel	nmen		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja			I					I						l
	ROHVEI SIONSIARIOI EN.	Ort:			Stand Ende:		Sachbe	earbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Kreditr		ungstechniken, die usfall auswirken (d				stquote bei	Double Default Effekte	Pos	Posit				chricht Angabe	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähi berücksio fähige Gai	ing eigener ingen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate		rücksichtigu	ngsfähige S	Sicherheiter	1	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verfustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapital	Erwarts (§	(-) Wertberichtig	Anzahl
		Gara	Kredito	Verwendung eige der Verlustquot Gewäh berücksichtigung Ansprüc Lebensvers	Berücksicht finan Siche	IF	RBA-Sicherl		gsfähige Gewähr	rchschnittliche p bei Ausfall (%)	chschnittliche La	IRBA-Positions	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzunger der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungstähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	leistungen	rognostizierte	ufzeit in Tagen	wert		TO	stellungen	er e e
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280	21															
290 300	22 23															
310 320	24 25															
330 340	26 27															
350	28	3														
360 370	29 30															
380 390	31 32															
400	33	3														
410 420	34 35															
430 440	36 37															
450	38	3														
460 470	39 40															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt															
	werden: Gesamtsumme	Aufalieden	una sämtlici	her IRBA-Positione	n die Snezi	alfinanzieru	ngen sind u	nd nach & 97 Se	olyV mit d	em einfach	n Risikon	ewicht				
		berücksich	ntigt werden		, a.o opozi	izici u	go omu u			c.much	sikog					
490 500	0% 50%															
510	70%															
520 530	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren 90%	1														
540 550	115% 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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		22a. Meld	ıng übe	er IRBA-Po	ositionen								IRBA E4a
IRB	A-Forderungsklasse:	Un	ternehm	en		Institutsr	ummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein			Ctond								
		Ort:			Stand Ende:			rbeiter/in:		Telefon:			in Tsd Euro
		Inte	F		K S	Substitutions	inderungst seffekten b sungsgrun	echniken m ei den IRBA dlagen	it -	줐ㅠ			
		ernes	RBA-B Kre			201100		diagon		BA-Be editrisil			
		Internes Ratingsystem	emessungsgrundli ditrisikominderung		berücksic fähige Gar	hrleistung htigungs- antien und lerivate	s Gewährleistung l	Substitution	onseffekte	messungsgrundla kominderungstech		IRBA-Positionsw	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme			1 1004.0									
	Bilanzielle Adressen-	Aufgliederui	ng samtli	cher IRBA-P	ositionen na	ich Art der F	osition						
020	ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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												
		Aufgliederun	g sämtlic	her IRBA-Po	ositionen, di	e einer Ratii	ngstufe ode	r einem Ris	ikopool zug	eordnet sin	d		
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1												
100	3												
110	4				-								
130	6												
140 150	7												
160 170	9												
180	11												
190 200	12 13												
210	14												
220	15 16												
240 250	17 18												
260	19	,											
270	20												Blatt 1

		22a. Meld	ung übe	r IRBA-P	sitionen								IRBA E4a
IRB	A-Forderungsklasse:	Un	ternehme	en		Institutsr	nummer:		Prüfziffer:		Name:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Nein			I				I		l		
	Konversionsfaktoren:	Ort:			Stand Ende:		Sachbea	ırbeiter/in:		Telefon:			in Ted Euro
					K			techniken m					in Tsd Euro
		Inte	E		S		seffekten b ssungsgrun	ei den IRBA idlagen	۱-	Krec IRB			
		mes F	3A-Be Kred				Als			A-Ber litrisik			
		Intemes Ratingsystem	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)		berücksic		Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	Substitutio	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten		IRBA	
		syster	ungsg		fähige Gar Kreditd	antien und lerivate	ihrleis	Cubstituti	SHISCHORIC	ingsgr		-Posit	
			rundla				tung t			undla stech		IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	
		P E	age vo	Mar			erück Ansp	(-) G	ရွ	ge na niken	d Adre	ert na	Adre
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	ır Beri niken	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)		_	sichti	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	ch Be mit Si	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	ch § s	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		Ratingstufe oder e sikopool zugeordne nostizierte Ausfallv scheinlichkeit (%)	ücksic (§ 100	darunter: nach der Laufzeitmethode, bewertungsmethod er IMM berechnet	Gara	Kreditderivate	gungs	tsumi	summ	rücksi	er: Au ausfal	99 Sol	er: Au ausfal
		ufe oc zugec e Aus hkeit	htigu	nach netho gsme erech	Garantien	leriva:	ifähig	me de	e der	chtigu	Berbil Irisika	>	ßerbil Irisiko
		der eir irdnet sfallwa (%)	S vo	der ide, thode net (b		ē	e son:	r Abg	Zugä	ung vo	anzie positi		anzie positi
		hr. em) SM			stige	änge	nge	eg n	le onen		le onen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
280													
300													
310													
330													
340 350													
360													
370													
390													
400													
420	35												
430													
450	38												
460													
	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach §												
480	97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederur	 ng sämtlic	her IRBA-Po	sitionen, di	e Spezialfin	anzierunge	n sind und n	ach § 97 Sc	lvV mit dem	n einfachen	Risikogewi	cht
490	0%	berücksichti	gt werder										
500													
510													
520	weniger als 2,5 Jahren												
530 540				-									
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 Riskogewicht angewendet wird												
580	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 SolwV, deren Nettobemessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

		22a. Mel	dung übe	r IRBA-Position	en										IRB/	A E4a
IRB	A-Forderungsklasse:		Unterne	hmen		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein					ī.									•
		Ort:			Stand Ende:		Sachbe	arbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
		Kreditrisiko	ominderung	stechniken, die sich auswirken (ohne	auf die pro Double Defa	gnostizierte ault Effekte	Verlustquo	te bei Ausfall	Double Default Effekte	Pos	Posit				chricht Angabe	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio fähige Gar	ng eigener ngen der juote bei ill: Als leistung chtigungs- antien und lerivate	Berü	cksichtigun	gsfähige Si	cherheiten		Berücksichtigun	itionswertgewichtete du Verlustquote	ionswertgewichtete dur	Risikogewichtete (§ 8-	Eigenkapita	Erwart ((-) Wertberichtig	Anzah
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sichemeiten	berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	gungsfähige Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB Meldebogen			
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positioner	nach Art de	er Position										
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV															
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme															
		Aufglieder	ıng sämtlich	ner IRBA-Positionen	, die einer R	atingstufe o	der einem F	Risikopool zug	eordnet s	ind	-					
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a): 1															
100	3															
110 120	4															
130	6															
140 150	7															
160	g															
170 180	10															
190	12															
200 210	13 14															
220	15	;														
230 240	16 17															
250	18															
260 270	19															
270	20										<u> </u>	<u> </u>			Blatt 3	

		22a. Mel	dung übe	r IRBA-Position	en										IRBA	A E4a
IRB	A-Forderungsklasse:		Unterne	hmen		Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Name:			
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein			1					l						
		Ort:			Stand Ende:		Sachbe	arbeiter/in:			Telefon:			in Ts	d Euro	
				stechniken, die sich auswirken (ohne				te bei Ausfall	Double Default Effekte	Pos	Posit				chricht Angabe	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio fähige Gar	ng eigener ngen der juote bei ill: Als leistung chtigungs- rantien und lerivate		icksichtigun	gsfähige Si	cherheiten		Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwartı ()	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl
			_	Verwendun der Verlus Ga berücksich An Leber	Berück		berücksichti BA-Sicherh		gsfähige G	rchschnittli bei Ausfall	chschnittlic	IRBA-Posi SolvV)	anforderun	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	ungen und	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Vertustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähi ge IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	ewährleistungen	che prognostizierte l (%)	he Laufzeit in Tagen	tionswert	gen	oeträge /)	Rückstellungen	nehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280 290	21 22															
300	23															
310 320																
330 340																
350	28															
360 370																
380 390																
400	33															
410 420																
430	36															
440 450																
460 470																
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA- Risikogewicht berücksichtigt															
	werden: Gesamtsumme	Aufglieder	ıng sämtlich	ner IRBA-Positionen	, die Spezial	finanzierun	gen sind und	i nach § 97 Sc	olvV mit d	em einfache	n Risikog	ewicht				
490	0%	berücksich	tigt werden													
500																
510																
520	weniger als 2,5 Janren															
530 540																
550	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs.															
560	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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

	23. Meldun	ng über IRBA-Posit	ionen					IRBA EN
IRBA-Forderungsklasse:	einzelnen Ur	tliche Angaben zu nterklassen von IRBA- erungsklassen		Institutsnummer:			Prüfziffer:	
	99901	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversions- faktoren:						
	Name:		Ort:		Stand Ende:			

												in	Tsd Euro
		Int			Ki S	ubstitutions	inderungs effekten b sungsgrur	techniken n bei den IRB/ ndlagen	nit A-				
		Internes Ratingsystem	IRBA-Bemessungsgru Kreditrisikominder		berücksic fähige G	hrleistung		Substitution	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrun Kreditrisikominderungst		IRBA-Position	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditris ikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+ 07+08	10	11	12
	Forderungsklasse Institute darunter: Kreditinstitute und Wertpapierhandels- unternehmen												
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 revolvierendes Mengengeschäft												
050	Gesamtsumme												
	Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Kleine und mittlere Unternehmen												

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

	23. Meld	ung über IRBA-Posit	tionen				 IRBA EN
IRBA-Forderungsklasse:	einzelnen	chtliche Angaben zu Unterklassen von IRBA- rderungsklassen		Institutsnummer:		Prüfziff er:	
	99901	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-Konversions- faktoren:					
	Name:		Ort:		Stand Ende:		

_									Double						in	Tsd Euro
		Kreditrisko	ominderun bei Aus	gstechniken, die fall auswirken (e sich au ohne Do	f die progn uble Defau	ostizierte V It Effekte)	'erlustquote	Default Effekte	Posit				Nachri	chtliche /	Angaben
		eige Schätzur Verlustq Ausfa Gewähr berücksic fähige G	endung ener ngen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- carantien litderivate	Berü	cksichtig	ungsfähige	Sicherheit	en	Berücksichti	tionswertgewichtete durch be	Positionswertgewichtete	Risikogewichteter IR	Eigenka	Erv	(-) Wertberid	Ans
				Verwe V Gewäh	Berü	berücksio	Sonstige chtigungsfä Sicherheite	hige IRBA-	gungsfähi	ารchnittlicl ม่ Ausfall (durchsch	BA-Positi	Eigenkapitalanforderungen	vartete Ve (§ 104	chtigunger	zahl der K
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtgungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA- Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	derungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
	Forderungsklasse Institute darunter: Kreditinstitute und Wertpapierhandels- unternehmen															
010	Gesamtsumme															
	Forderungsklasse Unternehmen darunter: Spezialfinanzierungen															
020	Gesamtsumme															
	Forderungsklasse Unternehmen: darunter: Kleine und mittlere Unternehmen															
030	Gesamtsumme															
	Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Durch Immobilien besichert											Ī				
040	Gesamtsumme															
	Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Qualifiziertes revolvierendes Mengengeschäft															
050	Gesamtsumme															
	Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Kleine und mittlere Unternehmen															
060	Gesamtsumme															

onen
-Positi
IRBA
g über
Jelduni
24. №

IRBA Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) Internes Ratingsystem Einer Ratingstufe zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%) Einer Ratingswiser Einer Ratingstufe zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%) Einer Ratingswiser Ein	er: Prüf- Stand Stand Stand Stand Stand In Install Stand Instand Instal	Pos prog	(-) Wertberichtig Rückstellt Erwarte Verlustbeträge nac Eigenkapitalanforder ewichteter IRBA-Positio SolvV ittionswertgewichtete dur nostizierte Verlustquote RBA-Positionswert nach Berücksichtigung ireditrisikominderungster Substitutionseffekte Substitutionseffekte	ete h § 104 SolvV ungen nswert nach § 84 chschnittliche bei Ausfall (%) darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen § 99 SolvV darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen dlage nach von chniken mit ten Gesamtsumme der Zugänge (-) Gesamtsumme der Abgänge	05 06 07=02 08 09 10 11 12 13 14 15 15	Übertrag ÜB Meldebogen															
	1	RBA Be	emessungsgrundlage vo litrisikominderungstechn	der Abgänge Kreditderivate Garantien r Berücksichtigung iken (§ 100 SolvV) Einer Ratingstufe zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr-	02 03 04		1. Gesamtheit der IRBA-Beteiligungspositionen, die zu einem ausfallwahr-scheinlichkeitsgesteuerten IRBA-Beteiligungsportfolio gehören (§ 78 Abs. 2 Nr. 1a Solw)	nen nach Rati	Ratingstufe(a): 1	0.5	t 10	9	- &	0,0	 12	2 1	15	16	18	10	70

	progn IR IF Kr	SolvV ionswertgewichtete dur ostizierte Verlustquote BA-Positionswert nach RBA-Bemessungsgrund Berücksichtigung editrisikominderungster Substitutionseffekte	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen § 99 SolvV darunter: Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen dlage nach von chniken mit	06 07=02 08 09 10 11 +05+06																
Institutsnummer: ziffer:	IF Kr	RBA-Bemessungsgrunc Berücksichtigung editrisikominderungster Substitutionseffek	§ 99 SolvV darunter: Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen dlage nach von chniken mit tten Gesamtsumme	07=02 +05+06																
Institutsnummer: ziffer:	Kr	Berücksichtigung editrisikominderungsted Substitutionseffek	dlage nach von chniken mit kten																	
	gstechniker ten bei der irundlagen	Substitutionseffekte		9																
	erun effek ngsg		(-) Gesamtsumme der Abgänge	05											F					
	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen	Als Gewährleistung berücksichti- gungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzen- bereinigte Beträde	Kreditderivate Garantien	03 04																
uegung		messungsgrundlage voi trisikominderungstechn															cogewichten			
Beteiligu	Inter	nes Ratingsystem	Einer Ratingstufe zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	10																
IRBA-Forderungsklasse:					22	2 2 2 4 4 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9 9	25	27 28	29	3 E &	3333	3000	37	39	2. Gesamtheit der IRBA-Beteiligungs-	einfachen Risikogewicht bewertet werden (§ 78	Aus. z. Nr. z. Solvy) Aufgliederung dieser IRBA-Beteiligungspositionen nach Risi	Risikogewicht: 190% 290%	370%	3.Gesamtheit der IRBA-Beteiligungspostionen, die zu einem modellgesteuerten IRBA- dereiligungsportfolio gehören (§ 78 Abs. 2 Nr.

		25. Meld	lung üb	er IRBA-Positionen								IRBA EV
IRI Fo	BA- rderungsklasse:	Verbrie	fungen	Institutsnummer:		Prüfziffer:			Name:			
. •	Verbriefungsart:	Summe	enblatt	Ort:				Stand E	Ende:			
												in Tsd Euro
		Gesamt		etische Verbriefung: Auf das v Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechnil		Verbriefungs- positionen	Krediti Subst	risikominderu itutionseffekt Bemessungs	en auf die	IRBA-	IRBA-B Kreditrisiko	
		Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositionen	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsbereinigte Beträge (a)	(-) Abgånge insgesamt	Nominalbetrag zurückbehaltener oder zurückerworbener Kreditbesicherung	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 SolvV)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: inkongruenzenbereinigte Beträge	effekte Anwend Kreditrisi ungstech die I Bemes	tutions- e durch lung von kominder- niken auf RBA- ssungs- dlage	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	 (-) Kreditrisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge
		riefungspositionen	Berücksichtigungsfähige finanzielle eiten: Schwankungsbereinigte Beträge (a)	Um Währungs- inkongruenzen berienigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	ückbehaltener oder Kreditbesicherung	gsgrundlage vor tigung von erungstechniken s. 1 SolvV)	thige Garantien und erivate: ereinigte Beträge	erücksichtigungsfähige nkongruenzenbereinigte äge	(-) Abgänge insgesamt	Zuflüsse insgesamt	h Anwendung von Substitutionseffekten	ach der umfassenden anzielle Sicherheiten: einigte Beträge
		01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11
010	Gesamtsumme											
011	darunter: Wiederverbriefungs- positionen											
020	Originator: Gesamtengagement											
030	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
031	А											
032	: В											
033	С											
034	D											
035	E											
070	Außerbilanzielle und derivative Adressen- ausfallrisikopositionen											
071	A											
072	. В											
073	С											
074	D											
075	E											
080	Vorzeitige Tilgung											

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

Blatt 1

IRBA EV

	BA- orderungsklasse:	Verbrief	ungen	Institutsnummer:		Prüfziffer:		1	Name:			
	Verbriefungsart:	Summe	enblatt	Ort:				Stand E	Ende:			
												in Tsd Euro
		Gesamth	ı	etische Verbriefung: Auf das v Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechnil		Verbriefungs- positionen		risikominderu titutionseffekt Bemessungs	en auf die	IRBA-	IRBA-Be Kreditrisiko	
		Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositioner	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsbereinigte Beträge (a)	Um V inkon be (-) Abgänge insgesamt berücksich Gara Kred	Nominalbetrag zurückbehaltener oder zurückerworbener Kreditbesicherung	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 SolvV)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzenbereinigte Beträge	effekte Anwend Kreditrisi ungstech die I Bemes grun	tutions- e durch lung von kominder- niken auf RBA- ssungs- dlage	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	 (-) Kreditrisikorninderungstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge
		sitionen	anzielle jte Beträge (a)	Um Währungs- inkongruenzen bereinigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	ner oder cherung	je vor niken	ntien und eträge	igungsfähige enbereinigte	Abgänge insgesamt	Zuflüsse insgesamt	ıng von ınseffekten	nfassenden cherheiten: räge
		01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11
09	Investor: Gesamtengagement											
09	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist											
10	Bilanzielle O Adressenausfall- risikopositionen											
10	1 A											
10	2 B											
10	3 C											
10	4 D											
10	5 E											
14	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall risikopositionen											
14	1 A											
14	2 B											
14	3 C											
14	4 D											
14												
15	Sponsor: Gesamtengagement											
16	austalinsikopositionen											
17	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall											

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

Blatt 2

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

	25. Meldung üb	er IRBA-Position	en					IRBA EV
IRBA- Forderungsklasse:	Verbriefungen	Institutsnummer:		Prüf- ziffer:		Name:		
Verbriefungsart:	Summenblatt	Ort:		_	Stand Ende:			

																			in	1 Tsd	Euro				
		IRBA-Bemess	Bemess (12) Po	sungsgru) von auf ositionen	ing der IRI indlage au Berbilanzie i nach IRB onsfaktore	s Spalte ellen A-					Aufg	gliede	erunç	g der	IRB	A-P	ositic	nsw	erte	nach	n Ris	ikog	ewicl	nten	
		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungstechniken	0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%	IRBA-Positionswert (§ 252 SolvV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 268 SolvV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugs- positionen				(Во	nität	Ra sstu	itingl fe 1	oasie bis 1	rter 1 be	Ansa ei Lar	atz ngfris	strati	ng)			
		icksichtigung sämtlicher schniken	*	<=20%	d <=50%	<=100%	52 SolvV)	kapital (§ 268 SolvV)		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		-								I														
032	В											l													
033	С																								
034	D																								
035	Е																								
070	Außerbilanzielle und derivative Adressen- ausfallrisikopositionen																								
071	А										ı														
072	В											I													
073	С																								
074	D																								
075	Е																								
080	Vorzeitige Tilgung																								

	25. Meldung üb	er IRBA-Positio	onen					IRBA EV
IRBA- Forderungsklasse:	Verbriefungen	Institutsnummer:		Prüf- ziffer:		Name:		
Verbriefungsart:	Summenblatt	Ort:			Stand Ende:			

							1				_		_	_			ı	n Tsd	Euro				
		IRBA-Bemess	Bemess (12) Po	ungsgru von auß ositionen	ng der IRE ndlage aus Berbilanzie nach IRB onsfaktore	s Spalte Ilen A-				А	ufglie	derun	ıg de	r IRBA	-Po	sitions	werte	nacl	h Ris	ikog	ewich	nten	
		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungstechniken	0%	%00=> bun %0<	%05=> pun %05<	%001=> bun %05<	IRBA-Positionswert (§ 252 SolvV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 268 SolvV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugs- positionen			(Br	onitäi	Rati sstufe	ngb e 1 b	asierte bis 11 b	r Ans ei La	satz ingfri	strati	ng)			
		cksichtigung sämtlicher chniken	6	<=20%	d<=50%	<=100%	2 SolvV)	(apital (§ 268 SolvV)		7 - 10%	13 18%	40 - 75%	100%	150%	200%	250% 225%	300%	350%	425%	500%	650%	750%	850%
	Investor:	12	13	14	15	16	17	18	19=17+ 18	20 2	1 2	2 23	24	42	43	44 25	45	46	26	47	27	48	49
090	Gesamtengagement	_			_																		
091	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																						
100	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																		ı				
101	A																						
102	В																						
103	С														Į	L		ı					
104	D														J	۱	L						
105	Е																						
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																		_				
141	A																						
142	В																						
143	С																						
144	D													_			L						
145	Е																						
150	Sponsor: Gesamtengagement										_							_					
160	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen																						
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																						

	25. Meldung üb	er IRBA-Positionen				IRBA EV
IRBA- Forderungsklasse:	Verbriefungen	Institutsnummer:	Prüfziffer:		Name:	
Verbriefungsart:	Summenblatt	Ort:	Stand Ende	:		

										,				in Tse	d Euro
		A	ufgliederung	g der IRB <i>i</i> Risikoge	A-Positio wichten	nswert	te naci	h	(-) Reduzien durch	Risikoge	Zuschlag z SolvV) bei Ve	Zuschlagsbe zur Erfassu	Aggregier	Eigenkapitala Ver	
		1	250%	Bankau licher F Ans	ormel	Durch	verfahren	Internes Einstufungs-	(-) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positions-wertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 SolvV)	Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert SolvV) bei Verstoß gegen die Sorgfaltspflichten nach § 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)	Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Aggregierte Kapitalanforderungen
		Mit Rating	Ohne Rating		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschau		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	IRBA-Positions-wertes Rückstellungen	wert (§ 253 SolvV)	A-Positionswert (§ 253 oflichten nach § 18a Abs. and 5 KWG (G)	eten IRBA-Positionswert kung bei synthetischen	hne Anwendung der gen	dem Abgang von IRBA erungsklassen	derungen
		28	29	30	31	32	33	34	35	36	40	41	37	38	39
010	Gesamtsumme														Übertrag ÜB- Meldebogen
011	darunter: Wiederverbriefungs- positionen														Übertrag ÜB- Meldebogen
020	Originator: Gesamtengagement														
030	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen														
031	A														
032	В														
033	С														
034	D														
035	Е														
070	Außerbilanzielle und derivative Adressen- ausfallrisikopositionen						•								
071	A														
072	В														
073	С														
074	D														
075	Е														
080	Vorzeitige Tilgung														

	25. Meldung üb	er IRBA-Position	nen							IRBA EV
IRBA- Forderungsklasse:	Verbriefungen	Institutsnummer:	Prüfziffer:					Name:		
Verbriefungsart:	Summenblatt	Ort:	Star	nd Ende:						
									in Tsd	l Euro
	Aufgliederun	g der IRBA-Positions	werte nach	(-) R	_	Zus SolvV;	Zuscl zur l	Ą	Eiger	

	verbriefungsart.]			J							in Tso	l Euro
		А	ufgliederunç	g der IRBA Risikoge		nswerl	te nac	ħ	(-) Reduzieru durch	Risikoge	Zuschlag zu SolvV) bei Ver	Zuschlagsbet zur Erfassur	Aggregier		
		1	250%	Bankau licher F Ans	ormel	Durchschau	verfahren	Internes Einstufungs-	(-) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positions-wertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert(§ 253 SolvV)	Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 SolvV) bei Verstoß gegen die Sorgfaltsprlichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)	Zuschlagsbeitag auf den risikogewichteten IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Aggregierte Kapitalanforderungen
		Mit Rating	Ohne Rating		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	schau		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	IRBA-Positions-wertes Rückstellungen	vert (§ 253 SolvV)	r-Positionswert (§ 253flichten nach § 18a Abs.nd 5 KWGG)	sten IRBA-Positionswert ung bei synthetischen	hne Anwendung der en	dem Abgang von IRBA rungsklassen	Jerungen
	Investor:	28	29	30	31	32	33	34	35	36	40	41	37	38	39
090	Gesamtengagement darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist														
100	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen														
101	А														
102	В														
103	С														
104	D														
105	E														
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen														
141	А														
142	В														
143	С														
144	D														
145															
150	Gesamtengagement														
160	austalinsikopositionen														
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen														

E VERSO in Tsd Euro 29 Aggregierte Kapitalanforderungen Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen 28 (-) Abzugsbetrag für Verbriefungspositionen 27 Vorzeitige Tilgungs-möglichkeit Angewandter 26 Konversionsfaktor Verbriefungspositionen (Bemessungsgrundlage vor Konversionsfaktoren) 25 Kontrolliert? (ja/nein) Außerbilanzielle Positionen und Derivate Sonstige 24 Qualifizierte Verbriefungs-Liquiditätsfazilität 23 Direktes Kreditsubstitut 22 Erstverlust position ohne Rating 2 Bilanzpositionen 20 Rating 19 Mezzaohne Rating nine 8 Rating Höchst-rangig 17 ohne Rating 16 Rating Stand Ende: Verbrief ungs-struktur 15 Erstverlustposition Eigenkapitalanforderungen vor Verbriefung % 4 (-) Wertberichtigungen und 5 Rückstellungen Verbriefte Positionen 72 ELGD % Anzahl der Positionen 9 Verwendeter Ansatz (SA/IRB/MIX) 60 Anteil des Instituts (%) 90 07 Gesamtbetrag Verbriefungen ohne ABCP-Programme Gesamtbetrag der verbrieften 90 Positionen zu Beginn der Verbriefung Datum der Verbriefung (MM/JJJJ) 9 Prüfziffer: 26. Sonderangaben zu den Verbriefungspositionen Stellung des Instituts: (SPONSOR / ORIGINATOR/ URSPRÜNGLICHER KREDITGEBER) 8 Einhaltung der Anforderung an den Selbstbehalt (§ 18a Abs. 1 KWG) 33 Selbstbehalt %-Anteil des Selbstbehalts zum 3 Meldestichtag 30 Art des Selbstbehalts Verbriefung/ Wiederverbriefung 32 Institutsnummer: 03 Verbriefungsart (Synthetisch / Traditionell) Kennung der Verbriefung 8 9 Interner Code

27. Meldung über Abwicklungsrisikopositionen

		in Tsd Euro	Eigenkapital- anforderung (§16 SolvV)	03		Übertrag ÜB- Meldebogen						Übertrag ÜB- Meldebogen					
	Stand Ende:		Zugunsten des Institutes bestehender Unterschieds- betrag	02													
			Vereinbarter Abrechnungs- preis	01													
Prüfziffer:	Ort:		Geschäftstage nach vereinbartem Abrechnungstermin		Gesamtsumme	Gesamtsumme Anlagebuch	0 bis 4	5 bis 15	16 bis 30	31 bis 45	mehr als 45	Gesamtsumme Handelsbuch	0 bis 4	5 bis 15	16 bis 30	31 bis 45	mehr als 45
Instituts- nummer	Name:				010	011	020	030	040	020	090	020	080	060	100	110	120

28.	Meldung zum	op	erat	ione	llen	Ris	iko			_				E OPR
	Institutsnummer:		Prüf	fziffer:		Na	me:			Ort:		Stand Ende:		
99901	Angabe des Geschäfts- jahres, auf das sich die Spalten 3 und 6 beziehen													
						lominale							in Ts	d Euro
		(Brutt	lelevan Indikato oertrag 271 So	or g) nach	(nur e Verw a Indikat	editvolur erforderli endung Iternativ ors) nac (3) Solv	ich bei eines en ch § 274	Eigenkapita		Nachrichtlich Anga	ıben (bei Verwer	ndung fortge	schrittener M	lessansätze)
	Geschäftsfelder	3. Jahr	2. Jahr	Vorjahr bzw. Vorvorjahr	3. Jahr	2. Jahr	Vorjahr bzw. Vorvorjahr	Eigenkapitalanforderungen (§§ 270, 273, 274 und 278 SolvV)	darunter: Aufgrund gruppeninterner Allokations- mechanismen zugeordnete Eigenkapitalanforderungen (§278 Abs. 4 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen vor Berücksichtigung von Reduktionseffekten aufgrund angemessener Berücksichtigung des enwarteten Verlustes in den internen Geschäftspraktiken und vor Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlagerung (§292 SolvV)	(-) Reduzierung der Eigenkapitalanforderungen aufgrund der angemessenen Berücksichtigung der erwarteten Verluste in den internen Geschäftspraktliken (§ 284 Abs. 2 SolvV)	(-) Reduzierung der Eigenkapitalanforderungen aufgrund der Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlägerung (§ 292 SolvV)	darunter: Berücksichtigung von Versicherungen (§292 SolvV)	Höhe des Überschreitungsbetrages der in § 292 Abs. 1 Satz 2 SolvV festgelegten Höchstgrenze bei der Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverfagerung
	4. Danisis dilentas	01	02	03	04	05	06	07	08	09 = 07-10-11	10	11	12	13
010	Basisindikator- ansatz (BIA)							Übertrag ÜB- Meldebogen						
020	Gesamtheit der unter den Standardansatz (STA) / Alternativen Standardansatz (ASA) fallenden Geschäfts- tätigkeiten							Übertrag ÜB- Meldebogen						
	Zuordnung der Geschäftstätig- keiten im Standardansatz- nach Geschäftsfeld: Unternehmens-													
030	-beratung													
040	Handel Wertpapier-													
060	provisionsgeschäft Firmenkunden-													
070	geschäft Privatkunden-													
080	geschäft Zahlungsverkehr und Abwicklung													
090	Denot- und													
100	Vermögens- verwaltung													
	Zuordnung der Geschäftstätig- keiten im Alternativen Standardansatz nach Geschäftsfeld:													
110	geschäft Privatkunden-													
	geschäft 3. Fortgeschrittene Messansätze (AMA)							Übertrag ÜB-Melde bogen						
130	a)													
	a) Informationen zum r Standardansatz erforde		ten Ind	likator s	ind nur	im Fall	le einer		ion eines forto	geschrittenen Messa	nsatzes mit der	n Basisindika	ator- bzw.	

Potenzieler Riekopering Gewichtung slaktor x Durchschmit der potenzielen Flisikoberinge der letzten 60 Geschäftstage
Potenzaleur Kris Coevichtungsfaktor x Dunchalmit der potenzalen Krisen Flakkoberge der Krisen en OG seschräftstage 08
Siektor X Suelzzi Potenzialen Krisen-Histobet Potenzialen Potenzialen Potenzialen Antifiksage der Histope der Antifiksage histopet Potenzialen Potenzi
E

M

29. Meldung über Marktrisikopositionen Verwendung eigener Risikomodelle

29. Meldung über Marktrisikopositionen Verwendung eigener Risikomodelle

∑

in Tsd Euro		Summe der Berücksichtigungsberfäge für passivisch ausgerichtete Zinsnettopositionen des Correlation Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 2 SolvV)	19												
	-	Summe der Summe der Berückschifgungsberäge in enkein jungsberäge in enkein jungsberäge in enkein jungsberäge in ander jungsberäge in ander jungsberäge in ander jungsberäge in gestellt	18												
	Nachrichtlich:	Gewichtungsfaktor nach § 314 Abs. 1 Satz 1 Nr. 2 Buchstabe b SoW	17												
		Gewichtungstakor nach § 314 Abs. 1 Sarz 1 Nr. nach § 314 Abs. 1 Sarz 1 Nr. I Buchstabo b SowV 2 Buchstabo b SowV	16												
Stand Ende:		Arzahl der Ausnahmen in den letzten 250 Geschäftslagen	90												
		Eigenmittelanforderung	05=Max [01,02] + Max [08,09] + Max [10,11] + Max [12,13,14] + 15	Übertrag ÜB-Meldebogen											
O tr		Zusätzliche Eigenkapitalanforderung für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 3)	15												
	relation Trading Portfolio	Nach § 318e SohV zuletzt ermittelter Betrag für das Correlation Trading Portfolio	14												
Name:	Anrechnungsbeträge für das Correlation Trading	Zwölfwöchiger Durchschnitt der nach § 318e SolvV zuletz ermitellen Beträge für das Correlation Trading Portfolio	13												
	An	Mindestanrechnungsbetrag für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 4 SoW)	12 = 8% * Max[18, 19]												
Prüfziffer:			ı	010 Positionen	Nachrichtlich: gegliedert nach Marktrisiko-kategorien	020 1 Zinsnettoposition	1.1 Allgemeines 030 Kursrisiko	1.2 Besonderes Kursrisiko	050 2 Aktiennettoposition	2.1 Allgemeines Kursrisiko	070 Kursrisiko	3 Währungs- gesamtposition	090 4 Rohwarenposition	5 Gesamtbetrag für 100 das allgemeine Kursrisiko	6 Gesamtbetrag für 110 das besondere

MKR FW

30. Marktrisikomeldung Währungsgesamtposition

	3						, co.			:
Institutsnummer:			Name:				Ort.			
									- in Tsd Euro -	- our
Positionen		Insgesamt (Spalte 02 bis 07)	OSD 20	GBP	CHF 04	JPY 05	CAD	Übrige Fremdwährungen	n Gold	
Aktivpositionen 1 Bilanzielle Vermögensgegenstände einschi. zeitanteiliger	010		ţ	3	;			;	3	
Ertäge 2. Liefer- und Zahlungsansprüche aus Kassaneschäften	020									
sonstigen Derivaten ohne Optionsrechte der Positionen 3 und 4	030									
Ansprüche auf Zahlung von Kapitalbeträgen aus Finanz-Swaps	040									
3. Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zustehende Liefer- oder Zahlungsansprüche aus Devisen- oder Goldoptionen	020									
4. Sonstige eigene Optionsrechte	090									
5. Sonstige Aktivpositionen	020									
Aktivpositionen insgesamt	100									
Passivpositionen 1. Bilanzielle Schulden einschließlich zeitanteiliger 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/Stillhatter zu erfüllende Liefer- oder Zahlungsverpfl. aus Devisen- oder Goldoptionen	150									
4. Sonstige fremde Optionsrechte	160									
5. Sonstige Passivpositionen	170									
Passivpositionen insgesamt	200									
Offene	210	+	+	+	+		+	+	+	
Einzelwährungsposition	220	4.	//-	16.	7		77	7"	77	
Nettowährungsposition (der größere Betrag - ohne Vorzeichen - der Zeilen 210/01 oder 220/01)	230							Offene Goldposition	ion	
abzüglich 50 % der ausgeglichenen Währungsposition in eng verbundenen Währungen	240	7								
zuzüglich offene Goldposition (Betrag der Zeile 230 /08)	250	+								
zuzüglich des Anrechnungsbetrages für Investmentanteile nach § 294 Abs. 6 Satz 6 SolvV	255	+				Nachri	Nachrichtlich:			
Nettoabgrenzungsbetrag für zeitant. Erträge/Aufwendungen (nur für Institute, bei denen die Abgrenzung nicht pro Fremdwährung verfügbar ist)	260	+				Struktu § 4 Abs	Strukturelle Währungspositionen nach § 4 Abs. 4 SolvV		99002	
Währungsgesamtposition (Summe der Zeilen 230 bis 260)	270		% 0'8 x	99001		Abzugs § 4 Abs	Abzugsposten in Fremdwährung nach § 4 Abs. 4 SolvV		80066	
			•	Anrechnungsbetrag fi	Anrechnungsbetrag für Währungsgesamtposition					

						Stand	Ende:	
Institutsnummer:Prüfziffer Na	me:						Ort:	
								- in Tsd Euro -
		In	sgesamt	Öle, Petroleum und		virtschaftl.	Metalle	Übrige Rohwaren
Positionen			01	Gas 02	Erze	eugnisse 03	04	05
Aktivpositionen 1. Unter Aktiva der Bilanz auszuweisende Rohwarenbestände	010							
Lieferansprüche aus Kassageschäften	020							
Termingeschäften	030							
Swapgeschäften	040							
3. Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zustehende Lieferansprüche	050							
Eventualansprüche auf Rückgabe von in Pension gegebenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	060							
Aktivpositionen insgesamt	100							
Passivpositionen 1. Lieferverpflichtungen aus Kassageschäften	110							
Termingeschäften	120							
Swapgeschäften	130							
Als Optionsberechtigter/Stillhalter zu erfüllende Lieferverpflichtungen	140							
Eventualverbindlichkeiten auf Rückgabe von in Pension genommenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	150							
Passivpositionen insgesamt	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			;	Summe A		
II. Zeitfächermethode								
				01		02		03
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen nac 297 Abs. 2 Satz 3 SolvV	:h §	300				x 0%		
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen vor nach der Verrechnung zwischen den Zeitfächern	und	310				x 3,0 %		
Summe der offenen Bereichspositionen nach Verrechnung		320				x 0,6 %		
Verbleibende offene Bereichsposition		330				x 15,0 %		
		340				Summe B		
		350	Anrechnungs	sbetrag für Rohwarenpositio	n (Zeile 230)+340)		

32. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition

Institutsnummer:	Prüfz	Prüfziffer:		Name:				Stand Ende:		Blatt 1
Allgemeines Kursrisiko Zinsnettoposition	risiko Zinsn	ettop	osition							- in Tsd Euro -
			Insgesamt (Summe aus Spalten 02 bis 16)		Kurzfristige	Kurzfristige Laufzeitzone		Mit	Mittelfristige Laufzeitzone	o.
Nominalverzinsung < 3 % bzw. gemäß Duration	ısung < 3 % 3 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%	% E ≥ Bunsı			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	90	20	90
I. Jahresbandmethode Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	110								
Insgesamt	passivische Ausrichtung	120								
darunter	aktivische Ausrichtung	130								
in Euro	passivische Ausrichtung	140								
darunter	aktivische Ausrichtung	150								
in US-\$	passivische Ausrichtung	160								
II. Durationmethode: Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	170								
Insgesamt	passivische Ausrichtung	180								
gewichtete Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	190								
Insgesamt	passivische Ausrichtung	200								
darunter. gewichtete	aktivische Ausrichtung	210								
Zinsnettoposition in Euro	passivische Ausrichtung	220								
darunter: gewichtete	aktivische Ausrichtung	230								
Zinsnettoposition in US-\$	passivische Ausrichtung	240								
Teilanrechnungsbetrag für das allgemeine Kursrisiko	srisiko	300								

32. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition

								Stand Ende:	<u>e:</u>	Blatt 2
Institutsnummer:	Prüf.	Prüfziffer:		Name:				Ō	Ort:	
Allgemeines Kursrisiko Zinsnettoposition	srisiko Zinsn	ettopo	osition							- in Tsd Euro -
						Langtristige	Langfristige Laufzeitzone			
Nominalverz bzw. gemä	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
Nominalverz	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		
			60	10	11	12	13	14	15	16
I. Jahresbandmethode Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	110								
Insgesamt	passivische Ausrichtung	120								
darunter:	aktivische Ausrichtung	130								
in Euro	passivische Ausrichtung	140								
darunter:	aktivische Ausrichtung	150								
in US-\$	passivische Ausrichtung	160								
II. Durationsmethode: Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	170								
Insgesamt	passivische Ausrichtung	180								
gewichtete Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	190								
Insgesamt	passivische Ausrichtung	200								
darunter: gewichtete	aktivische Ausrichtung	210								
Zinsnettoposition in Euro	passivische Ausrichtung	220								
darunter: gewichtete	aktivische Ausrichtung	230								
Zinsnettoposition in US-\$	passivische Ausrichtung	240								

Stand Ende:

32. Marktrisikomeldung Zinsnettoposition

Institutsnummer:		Name:			Ort:	
Besonderes Kursrisiko Zinsnettoposition	topos	ition				– in Tsd Euro -
Positionen		Zinsnettoposition	Gewichtungssätze	risikogewichtete Zinsnettoposition	Gewichtung nach § 303 Abs. 1	Anrechnungsbeträge
		01	02	03	04	90
Nettopositionen I.S. von § 303 Abs. 2 und Abs. 2	310		% 0'0 x			
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 3 Restlaufzeit bis 6 Monate	320		x 3,125 %			
Restlaufzeit über 6 Monate bis zu 2 Jahren	330		x 12,5%			
Restlaufzeit von mehr als 2 Jahren	340		× 20,0%			
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 1	350		× 100,0 %		% 8 X	
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 4	360		x 150,0 %			
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 6	380					
Summe Zinsnettopositionen	400			Tellanrechnungsbetra	Tellanrechnungsbetrag 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 § 307Abs. 1 Satz 1	200		X 32%	
Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 2	510		X 40 %	
Summe	520			

MKR AK

Stand Ende:

33. Marktrisikomeldung Aktiennettoposition

Ort:	Anrechnungsbeträge für das besondere Kursrisiko	Spalte 08 x 8,0%	60									
	<u> </u>									ө		
	position									Summe	B	S L
	Aktienbrutto		80								ndere Kursrisiko (Summe der Spalte 09)	nnettopositio
	Anrechnungsbeträge für Aktienbruttoposition das allgemeine Kursrisiko	Spalte 03 x 8,0 %	04								Teilanrechnungsbetrag für das besondere Kursrisiko (Summe der Spalte 09)	Anrechnungsbetrag für Aktiennettoposition
	tion	ition)								60	nrechn	Α
Name:	Aktiennettoposition	(saldierte Nettoposition)	03							Ilgemeine Kursrisiko (Summe der Spalte 04)	Teila	
ı	zelpositionen	passivische Ausrichtung	02							Teilanrechnungsbetrag für das allgemeine Kursrisiko (Summe der Spatte 04)		
Prüfziffer:	Aktiennettoeinzelpositionen	aktivische Ausrichtung	01							Teilan		
1	_	" F		010	020	030	040	020	090	020	080	060
Institutsnummer.	Nationale	Markt des Emittenten		Deutschland	Frankreich	Großbritannien	Japan	USA	übrige Länder			

Institutsnummer:		Prüfziffer:	3 1 1117
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanz- holding- Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbear- beiter/in:	
999901 Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1), Konzernabschlus gemäß § 10a Abs 7 KWG {IAS =(2) HGB = (3)}	5	Telefon:	

in Mio Euro

			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
0800	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 Berücksichtgung 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

Institutsnummer	Prüfziffer:
Übergeordnetes Unternehmen:	Instituts-/ Finanz- holding- Gruppe:
Stand Ende:	Sachbear- beiter/in:
999901 Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1 Konzernabschulu gemäß § 10a At 7 KWG (IAS =(2 HGB = (3))	s i.

in Mio Furo

			in Mio Euro	-
	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 02
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		
0120	1.1.2.2	Anteile in Fremdbesitz (minority interest)		=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	Zwischengewinn / Zwischenverlust (aufsichtlich)		= 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

			`,
Institu	utsnummer:	Prüf	fziffer:
		1.14.	
	ļ		
Übar		lundi	tituts-/
	geordnetes		
Unte	ernehmen:	Fin	nanz-
		hole	lding-
		Gru	uppe:
	!		
Sta	and Ende:	Sach	hbear-
0.0	and Endo.		ter/in:
		Den	ter/iii:
999901	Davashnung		
999901	Berechnung gemäß § 10a	Tele	lefon:
	Abs.6 KWG (=1);		
	Konzernabschluss		
	gemäß § 10a Abs.		
	7 KWG (IAS =(2);		
	HGB = (3)}		
	· · //		

in Mio Furo

			in Mio Euro	,
	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare 02
0180	1.1.2.4a	(-) Wesentliche Verluste des laufenden Geschäftsjahres, Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 3b KWG	<u> </u>	02
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	Zwischengewinn / Zwischenverlust (aufsichtlich)		= 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	(-) Nettogewinne aus der Kapitalisierung künftiger Erträge verbriefter Forderungen		§ 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	Im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften (Prudential Filters)		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

	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		(
Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanz- holding- Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbear- beiter/in:	
999901 Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG {IAS =(2); HGB = (3)}		Telefon:	

in Mio Euro

			in Mio Euro	
	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
			(a) 01	02
0320	1.1.2.6.07	Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf finanzielle Verbindlichkeiten (eigenes Kreditrisiko)	01	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	Sonderposten für allgemeine Bankrisiken nach § 340g HGB		
0430	1.1.4	Andere und landesspezifische Kernkapitalbestandteile		=1.1.4.1a+1.1.4.3+1.1.4.4
0451	1.1.4.1a	Sonstiges Kapital		=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
	1	-1	I.	Blatt 4

	•	•	J 11 /
Institutsnummer:		Prüfziffer:	
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanz- holding- Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbear- beiter/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
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	Korrekturposten (positiv) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften		
0470	1.1.4.4	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		
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
				Blatt 5

Instit	utsnummer:	Prüfziffer:
Über	geordnetes	Instituts-/
	ernehmen:	Finanz-
		holding-
		Gruppe:
C+	and Ende:	Sachbear-
310	and Ende.	beiter/in:
999901	Berechnung gemäß § 10a	Telefon:
	Abs.6 KWG (=1);	
	Konzernabschluss gemäß § 10a Abs.	
	7 KWG {IAS =(2);	
	HGB = (3)	

	in Mio Euro				
	ID	Bezeichnung	Betrag (a) 01	Kommentare 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	(-) 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			
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	Ergänzungskapital		=1.2.1+1.2.2+1.2.3	
0560	1.2.1	Ergänzungskapital 1. Klasse		=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	Gekappte, als Ergänzungskapital anrechenbare Kernkapitalbestandteile		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	Korrekturposten für aus dem Kernkapital übertragene Bewertungseffekte (Prudential Filters)		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	
	1			Blatt 6	

Instit	utsnummer:	Prüfziffer:
	geordnetes ernehmen:	Instituts-/ Finanz- holding- Gruppe:
Sta	and Ende:	Sachbear- beiter/in:
999901	Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG {IAS =(2); HGB = (3)}	Telefon:

	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
		Bezeloimang	(a)	Kommentare
				00
0640	1.2.1.3	Nijeld wellelede December in	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		Der Ausweis erfolgt unter Abzug des auf die
		(abzüglich Marktpflegeposition)		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 längerfristiger 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;		

			(eare zzum manzmeranig en appe)
Institutsnumme	r:	Prüfziffer:	
Übergeordnete Unternehmen:		Instituts-/ Finanz- holding- Gruppe:	
Stand Ende:		Sachbear- beiter/in:	
999901 Berechnun gemäß § 10 Abs.6 KWG (i Konzernabsch gemäß § 10a 7 KWG (IAS = HGB = (3)))a = =1); =11uss Abs.: (2);	Telefon:	

			in Mio Euro	
	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
			(a)	
			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
	1	1	1	Blatt 8

		· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
Instit	utsnummer:	Prüfziffer:
	!	
Über	geordnetes	Instituts-/
	ernehmen:	Finanz-
		holding-
		Gruppe:
		спирре.
C+	and Ende:	Sachbear-
318	and Ende:	
		beiter/in:
999901	Berechnung	
999901	gemäß § 10a	Telefon:
	Abs.6 KWG (=1);	
	Konzernabschluss	
	gemäß § 10a Abs.	
	7 KWG (IAS =(2);	
	nub = (3)}	
	HGB = (3)}	

	in Mio Euro				
	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare	
			(a)		
			01	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	Kernkapital (gesamt) für Solvenzzwecke		= 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	Ergänzungskapital (gesamt) für		=1.2+1.3.T2* Darüber hinaus sind hier die Beträge aus Pos.	
		Solvenzzwecke		1.7 als Abzugspositionen zu erfassen, die mit	
0980	1.6	Genutzte, verfügbare Drittrangmittel		Ergänzungskapital unterlegt werden. =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.		§ 10 Abs. 2c Nr. 3 KWG: Positionen, die allein wegen einer	
		3 KWG		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		Der Ausweis erfolgt unter Abzug der auf die	
		Verbindlichkeiten (abzüglich		gruppenangehörigen Unternehmen entfallenden kurzfristigen	
1020	1.6.4	Marktpflegeposition) (-) Schwer realisierbare Aktiva sowie		nachrangigen Verbindlicheiten	
1020	1.0.4	Verluste von Tochterunternehmen gemäß			
		§ 10 Abs. 2c Satz 4 KWG			
1030	1.6.5	(-) Korrekturposten gemäß § 10 Abs. 2c		Drittrangmittel + freies EK < 2,5 x FKK (Satz 2) bzw. 2 x FKK	
		Satz 2 und 3 KWG		(Satz 3)	
1040	1.6.LE	nachrichtlich:		=1.3.LE+1.6.1+1.6.2+1.6.3+1.6.4+1.6.5	
		Eigenmittel für die Großkreditgrenze im			
		Gesamtbuch			
1050	1.6.6	Berücksichtigung sonstiger Positionen		1.6.6.1	
		bei der Berechnung der genutzten,			
		verfügbaren Drittrangmittel			
	1	•		Blatt 9	
				2.00	

		·		,	o ,
Instit	utsnummer:		Prüfziffer:		
			ì		
Über	rgeordnetes		Instituts-/		
Unt	ernehmen:		Finanz-		
			holding-		
			Gruppe:		
Sta	and Ende:		Sachbear-		
			beiter/in:		
		т	1		
999901	Berechnung gemäß § 10a		Telefon:		
	Abs.6 KWG (=1);				
	Konzernabschluss	il			
	gemäß § 10a Abs.				
	7 KWG {IAS =(2); HGB = (3)}				
	1100 = (3)				

	in Mio Euro			
	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
			(a)	
			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	(-) 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		
1180	1.8.2	Bruttobetrag der längerfristigen nachrangigen Verbindlichkeiten		
1190	1.8.3	Mindestanfangskapital		
		•		Blatt 10

			`	•• /
Instit	utsnummer:	Prüfziffer:		
Über	geordnetes	Instituts-/		
	ernehmen:	Finanz-		
		holding-		
		Gruppe:		
Sta	and Ende:	Sachbear-		
		beiter/in:		
999901	Berechnung	Telefon:		
	gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1);			
	Konzernabschluss			
	gemäß § 10a Abs.			
	7 KWG {IAS =(2);			
	HGB = (3)			

	in Mio Euro										
	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare							
			(a)								
			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 Zelle010/ 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							

manta	ioikopooitionen ana zain operationen	chen monto (montato bzw. i manzinoramig Grappe)
Institutsnummer:		Prüfziffer:
Übergeordnetes Unternehmen:		Instituts-/ Finanz- holding- Gruppe:
Stand Ende:		Sachbear-beiter/in:
999901 Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1); Konzernabschluss gemäß § 10a Abs. 7 KWG {IAS =(2); HGB = (3)}		Telefon:

	ID.			
	ID	Bezeichnung	Betrag (a)	Kommentare
1000	0.4.440	lour frieding Faudamus and a	01	02
	2.1.1.1a.13	kurzfristige Forderungen an Unternehmen (sind in der Forderungsklasse "Unternehmen" mit aufzuführen)		
	2.1.1.1a.14	Investmentanteile		Anlage 3 Nr. 46 Zeile 010/ 22
	2.1.1.1a.15 2.1.1.1b	sonstige Positionen IRBA-Forderungsklassen (ohne		Anlage 3 Nr. 48 Zelle 010/ 22
1420	2.1.1.10	Verbriefungen)		
1430	2.1.1.1b.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		
	2.1.1.1b.02	Institute		
	2.1.1.1b.03	Unternehmen		
	2.1.1.1b.04	Mengengeschäft		
	2.1.1.1b.05	Beteiligungen		
	2.1.1.1b.06	Sonstige kreditunabhängige Aktiva		
	2.1.1.2	KSA-Verbriefungstransaktionen		Anlage 3 Nr. 50 Zelle 010/33
1491	2.1.1.2*	darunter: Wiederverbriefungen		Anlage 3 Nr. 50 Zelle 011/33
1500	2.1.2	Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRBA)		=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	IRB-Ansatz, wenn eigene Schätzungen weder für die Ermittlung der Verlustquote bei Ausfall noch für IRBA- Konversionsfaktoren genutzt werden		2.1.2.1.01 bis 2.1.2.1.03 Anlage 3 Nr. 51a Zelle 010/24
1520	2.1.2.1.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		Anlage 3 Nr. 52a Zelle 010/ 24
1530	2.1.2.1.02	Institute		Anlage 3 Nr. 53a Zelle 010/ 24
1540	2.1.2.1.03	Unternehmen		Anlage 3 Nr. 55a Zelle 010/ 24
1550	2.1.2.2	IRB-Ansatz, wenn eigene Schätzungen für die Ermittlung der Verlustquote bei Ausfall und/oder der IRBA- Konversionsfaktoren genutzt werden		2.1.2.2.01 bis 2.1.2.2.04 Anlage 3 Nr. 51 Zelle 010/24
1560	2.1.2.2.01	Zentralregierungen und Zentralbanken		Anlage 3 Nr. 52 Zelle 010/ 24
1570	2.1.2.2.02	Institute		Anlage 3 Nr. 53 Zelle 010/ 24
1580	2.1.2.2.03	Unternehmen		Anlage 3 Nr. 55 Zelle 010/ 24
1590	2.1.2.2.04	Mengengeschäft		Anlage 3 Nr. 54 Zelle 010/ 24
1600	2.1.2.3	Beteiligungen		Anlage 3 Nr. 57 Zelle 010/ 13
1610	2.1.2.4	IRBA-Verbriefungspositionen		Anlage 3 Nr. 58 Zelle 010/ 39
1611	2.1.2.4*	darunter: Wiederverbriefungen		Anlage 3 Nr. 58 Zelle 011/ 39
		model verbrierungen		Blatt 12

		•		,	o ,
Instit	utsnummer:		Prüfziffer:		
Über	geordnetes		Instituts-/		
Unternehmen:			Finanz-		
			holding-		
			Gruppe:		
			•		
Sta	and Ende:		Sachbear-		
			beiter/in:		
999901	Berechnung		Telefon:		
	gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1);				
	Konzernabschluss				
	gemäß § 10a Abs.				
	7 KWG {IAS =(2); HGB = (3)}				
	= (0);				

			in Mio Euro	
	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
			(a)	
			01	02
1620	2.1.2.5	Sonstige kreditunabhängige Aktiva		keine Verknüpfung mit einem anderen Meldebogen
1630	2.2	Abwicklungsrisiken		2.2.1 und 2.2.2
1631	2.2.1	Abwicklungsrisiken im Anlagebuch		Anlage 3 Nr. 60 Zelle 011/ 03
1632 1640	2.2.2	Abwicklungsrisiken im Handelsbuch Eigenmittelanforderungen für		Anlage 3 Nr. 60 Zelle 070/ 03 2.3.1 und 2.3.2
1040	2.3	Marktrisikopositionen		2.3.1 uliu 2.3.2
1650	2.3.1	Eigenmittelanforderungen für die Marktrisikopositionen nach den Standardverfahren		2.3.1.1 bis 2.3.1.4
1660	2.3.1.1	Zinsnettoposition		2.3.1.1.01 bis 2.3.1.1.03
1000	2.3.1.1	Zinsnettoposition		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	Allgemeines und besonderes Kursrisiko Zinsnettoposition		Anlage 3 Nr. 65 Zellen 300/01, 420/05 und 520/03
1662	2.3.1.1.02	Besonderes Kursrisiko Verbriefungspositionen im Handelsbuch		Anlage 3 Nr. 70 Zelle 010/61
1663	2.3.1.1.03	Besonderes Kursrisiko Correlation Trading Portfolio		Anlage 3 Nr. 71 Zelle 010/45
1670	2.3.1.2	Aktiennettoposition		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	Währungsgesamtposition		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	Rohwarenposition		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	Eigenmittelanforderungen für die Marktrisikopositionen bei Verwendung eines eigenen Risikomodells		Anlage 3 Nr. 62 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. 61 Zelle 010/07
1730	2.4.2	Standardansatz/alternativer Standardansatz		Anlage 3 Nr. 61 Zelle 020/07
1740	2.4.3	Fortgeschrittene Messansätze		Anlage 3 Nr. 61 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
	•			Blatt 13

Institutsnummer:	Prüfziffer:
Übergeordnetes Unternehmen:	Instituts-/ Finanz- holding- Gruppe:
Stand Ende:	Sachbear-beiter/in:
999901 Berechnung gemäß § 10a Abs.6 KWG (=1) Konzernabschlus gemäß § 10a Abs 7 KWG {IAS =(2) HGB = (3)}	

in Mio Euro

	ID	Bezeichnung	Betrag	Kommentare
			(a)	
			01	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.

		35. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)										KSA QS Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:	Sur	nmenblatt 2 3 Nr. 36 - 49)	-	nummer:	Prüfziffer:			Übergeordnetes Unternehmen:			
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
					1				in !			Euro
		darunter. Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode. SM oder IMM berechnet (a) KSA-Bernessungsgrundlage vor Berückschtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgi Wertberichtigungen und Rückstellungen		(-) Wertberichti (1) gen	KSA-Beme Kreditrisik	Kreditrisi	n bei den	KSA-Beme Kreditrisikon				
				jungen und Rückstr eldeten KSA-Positi	ssungsgrundlage v ominderungstechnil	Als Gewährleistungen berücksichtigungs- fähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzen- bereinigte Beträge		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sonstige / Lebensv Inkongruenze	Substitutionseffekte		ssungsgrundlage na ninderungstechniken
		r Berücksichtigung von (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. I Rückstellungen	darunter: 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 Kredifrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditriskominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Bilanzielle											
020	Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170 180	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210 220	darunter: Überfällige Positionen 200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

		e Verbriefungspositionen							KSA QS Blatt 2			
	170.5		- bzw. Finai latt (Anlage 3	nzholding-Gruppe)]		Üb	ergeordnetes		
	KSA-Forderungsklasse:		36 - 49)	Inst	tutsnummer:		Prüfziffer:			Internehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:			Telefon:			
		Kradi	trisikomindarı	ungstechniken mit							in Mic	Euro
		Auswi berücksicht	irkungen auf o Bemessungs tigungsfähige	lie Höhe der KSA-	KSA-Beme	Adressen	ederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen n	ach KSA-		Risikogev	
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallriskopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfäktorfür Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17-	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position									0,5*18		Übertrag ÜB Meldebogen
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
940	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Dariehens- 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											
070	Risikogewichten 0%											
080	10%											
90	20%											
10	35% 50%											
20	darunter: Überfällige Positionen											
30	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
40	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
45	70%											
50	75%											
70	100%											
80	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
90	anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien											
200	besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

KSA QS

		36. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)										KSA Q1 Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:	Zentralregierungen		_	Institutsnummer:		Prüfziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:			
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
		I									in Mid	Euro
		KSA-Bem Kreditrisikon We		(-) Wertberichti (1) gem	KSA-Bemi Kreditrisik	Kreditrisi			mit Substitutionseffekten bei den ingsgrundlagen			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		dannter: Nach der Laufzeitmei Marktbeweitungsmeinode, SM o berechnet (a) emessungsgrundlage vor Berücksichtigu kominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 Sol Wertberichtigungen und Rückstellungen		gungen und Rückst ıeldeten KSA-Positi	essungsgrundlage vominderungstechni	Kreditd Inkongr		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sonstige Au Lebensve Inkongruenzer	Substitutionseffekte		
		KSA-Bemessungsgrundläge vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	ewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	ch Berücksichtigung von mit Substitutionseffekten
		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 Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle											
030	Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
145	besicherte Positionen 70%											
150												
160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

36. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)												KSA Q1 Blatt 2
	KSA-Forderungsklasse:	Zentralre	gierungen	Insti	Prüfziffer:				oergeordnetes Unternehmen:			
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbearbeiter/in:			Telefon:			
										in Mic	Euro	
		Auswi berü	rkungen auf d Bemessungs cksichtigungs	ingstechniken mit die Höhe der KSA- sgrundlage: fähige finanzielle imfassenden Methode	KSA-Bem	Aufgliederung der außerbilanz Adressenausfallrisikopositionen n Konversionsfaktoren nach § 50			ach KSA-		Risikoge	
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallirsikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sichemeiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungstaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfähör ür Sichenungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kredirisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA-											Übertrag ÜB Meldebogen
020	Positionen nach Art der Position Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und											
	Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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% 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 Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
180	anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien											
190 200	besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

			dung über KS s- bzw. Finan			Verbriefu	ngspositi	onen				KSA Q2 Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:	Regional	regierungen und örtliche körperschaften	_	nummer:		Prüfziffer:		Übe	ergeordnetes Internehmen:		
	Institutsgruppe /	Gebiets	korperschaiten	Stand	1	l						
	Finanzholding-Gruppe:			Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:		in Mic	o Euro
		Σ.		(-) W		Kua dikula i			maik Crub akiku	dia na affalita		
		KSA-B editrisi		ertberi (1)	KSA-B Kredit	Kieuitiisii	kominderung KS		ngsgrundlag		ii bei deli	(SA-Be
		emess komin Wertb		chtigu gemel	emess	Als Gewäh	rleistungen					komin
		ungsg derung erichtig	dar Mark	ngen u deten k	ungsg	berücksid fähige Gar	htigungs- antien und	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Ger In	Substitution	onseffekte	ungsgr
		rundla stechr gunger	unter: tbewer	nd Rüc (SA-Po	rundlag	Inkongr	erivate: uenzen- e Beträge	sichti- ähige tielle neiten	Gewährleistung sonstige Au Lebensve Inkongruenzer			undlag stechr
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. Nach der Laufzeitmethode. Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	kstellu ositione	KSA-Bemessungsgrundiage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)				ewährleistung berücksichtigungsf sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge			KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		Berück § 49 At Rückste	ach der Laufz ngsmethode, berechnet (a)	ıngen, en geb	Berück า (§ 49		<u>~</u>	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	berücksichtigungsfähige nsprüche sowie ersicherungen: nbereinigte Beträge	(-)		ı Berüc nit Sub
		(sichtig os. 2 S ellunge	ifzeitm e, SM (a)	die für ildet w	(sichtig	Garantien	Kreditderivate	elle Si ache N	sichtig he sow rungen igte Be	Gesamt- summe der	Gesamt- summe der	ksichti stitutio
		olvV) z	ethode oder II	die in urden	Solv\	tien	rivate	cherhe //ethod	ungsfä /ie : eträge	Abgänge	Zugänge	gung v
		on zgl.	WM ,	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	59			iten: e	àhige			on de
		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 Adressenausfallrisiko-											
020	positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall-											
	risikopositionen Nichtderivative Geschäfte mit											
	Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare											
040	Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und											
	Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
050	Derivative Adressenausfall- risikopositionen und											
030	Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV											
	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen											
060	produktübergreifenden Aufrechnungsverein-barungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
	Aufgliederung sämtlicher KSA-											
	Positionen nach Risikogewichten											
070 080	0% 10%											
090	20%											
100 110	35% 50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210 220	darunter: Überfällige Positionen 200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

		(Instituts-	bzw. Fina	SA-Positionen ohne nzholding-Gruppe)	Verbriefu	ngspositi	ionen					KSA Q2 Blatt 2
	KSA-Forderungsklasse:	ört	jierungen und liiche rperschaften	Insti	itutsnummer:		Prüfziffer:			oergeordnetes Unternehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
											in Mic	Euro
		Auswi berü	rkungen auf o Bemessungs cksichtigungs	ingstechniken mit die Höhe der KSA- sgrundlage: fähige finanzielle imfassenden Methode	KSA-Bem	Adressen	ederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen n	ach KSA-		Risikoge	
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungstaktoren für berücksichtigungstähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungstäktor für Sichenungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kredtriskominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV 15-5-20	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA-											Übertrag ÜB Meldebogen
	Positionen nach Art der Position Bilanzielle											
020	Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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% 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 Durch Immobilien											
190 200	besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

			dung über KS ts- bzw. Finar			Verbriefu	ngspositio	onen				KSA Q3 Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:	sonstig	ge öffentliche Stellen	1	nummer:		Prüfziffer:		Üb	ergeordnetes Internehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
											in Mic	Euro
		KSA-Bem Kreditrisikor We		(-) Wertbericht (1) ger	KSA-Bem Kreditrisi	Kreditrisi	kominderung KS		mit Substitu		n bei den	KSA-Beme Kreditrisikor
		emessungsgrundlage vor Berücksichtigu kominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 Sol Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. Nac Marktbewertun b	igungen und Rückst neldeten KSA-Positi	essungsgrundlage v kominderungstechni	Kreditd Inkongr		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sonstige Ar Lebensve Inkongruenzer	Substitution	onseffekte	essungsgrundlage n
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. 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 Kredinsikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	ewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 +10
010	Gesamtsumme										I.	
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle											
030	Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

	38. Meldung über KS (Instituts- bzw. Final		Verbriefu	ngspositio	onen					KSA Q3 Blatt 2
KSA-Forderungsklasse:	sonstige öffentliche Stellen	Inst	itutsnummer:		Prüfziffer:			oergeordnetes Unternehmen:		
Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:		Sachbear	beiter/in:		Telefon:		in Mic	Euro
	ingstechniken mit lie Höhe der KSA- grundlage: finanzielle Sicherheiten	KSA-Be	Adressena	usfallrisiko	r außerbilanzi positionen na en nach § 50	ich KSA-		Risiko		

	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
											in Mic	Euro
		Auswi berücksicht	rkungen auf d Bemessungs igungsfähige	ingstechniken mit lie Höhe der KSA- igrundlage: finanzielle Sicherheiten enden Methode	KSA-Beme	Adressen	ederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen n	ach KSA-		Risikogev	
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallirsikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfäktor für Sichenungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kredirisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17-	21	22
010	Gesamtsumme									0,5*18		Übertrag ÜB Meldebogen
	Aufgliederung sämtlicher KSA-											ivieldebogen
	Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowies onstige 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
140	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
145	besicherte Positionen 70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200 210	150% darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											
	JonougoSikogowionic											

			dung über KS ts- bzw. Finan			Verbriefu	ngspositi	onen				KSA Q4 Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:	mu	ultilaterale klungsbanken	_	nummer:		Prüfziffer:			ergeordnetes Internehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
				·							in Mi	Euro
		KSA-Beme Kreditrisikom Wei) Wertberichtig (1) gem	KSA-Berne Kreditrisik	Kreditrisi		gstechniken A-Bemessu		utionseffekte gen	n bei den	KSA-Bemes Kreditrisikom
		issungsgrundlage v iinderungstechnike rberichtigungen un	darunter: Nac Marktbewertun b	jungen und Rückst eldeten KSA-Positi	ssungsgrundlage v ominderungstechni	berücksid fähige Gar Kreditd Inkongr	rleistungen chtigungs- cantien und erivate: uenzen- e Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistu sonstige Leben Inkongruen	Substitution	onseffekte	ssungsgrundlage n iinderungstechnike
		KSA-Bemessungsgrundläge vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	 (-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeidelen KSA-Positionen gebildet wurden 	KSA-Bernessungsgrundlage vor Berücksichtgung von Kredtrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle											
030	Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Dariehens- 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%					1						
100	20% 35%					+						
110	50%					İ						
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
140	besicherte Positionen					+						
145	70%											
150	75%					-						
160 170	100% darunter: Überfällige Positionen					-						
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

SSAF or derungskissee: Treatment and property and property and a second property and a					SA-Positionen ohne nzholding-Gruppe)		ungsposit	tionen					KSA Q4 Blatt 2
Secretary Secr		KSA-Forderungsklasse:			Inst	itutsnummer:		Prüfziffer:					
Audiglicianing car autherbitionnellar in a service of the company of the first or the company of the first or the company of the first or the company of the					Stand Ende:		Sachbea	arbeiter/in:		Telefon:			
12 13 14 15-11-12 16 17 18 19 00-15-16- 21 22 22 23 24 25-12- 25 25-12-			Auswi	rkungen auf d Bemessungs	die Höhe der KSA- sgrundlage:	KSA-I	Adressen	ausfallrisiko	positionen r	ach KSA-			Euro
12 13 14 15-11-12 16 17 18 19 02-15-16 19 02-17 21 22 22 22 22 23 24 24 24			Sicherheite	en nach der u	ımfassenden Methode	Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditriskominderungstechniken					KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	kogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
Contents				13			16	17	18	19	0,8*17-	21	22
Peatitions nach Art der Peatition Pe	010												Übertrag ÜB Meldebogen
Eliacorie Adresensus afairitis Acordina mental formation of the control of the co		Positionen nach Art der											
Addressensus fail- ristopositionen Nethedreviere Ceschäfte mit sowie sonstige Pensione-, Ourhehmet unterschechtssen sowie sonstige Pensionen Iz Abs. 3 Sowi Ourhehmet unterschechtssen sowie sonstige Pensionen Aufrechnungsveitionen nach § Iz Abs. 3 Sowi Affrechnungsveitin-barringen nach § Iz Abs. 4 Sowi Aufrechnungsveitin-barringen nach § Iz Abs. 5 Sowi	020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach §											
Sichehaltennachachüssen sowie sonstige Ponsiones, 200 Darfehmer- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 Solvy V Derivative Adressenausfall- risikopositionen und Aufrechungspositionen nach § 12 Abs. 3 Solvy V Aufrechungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergelenden Aufrechungsverein-barungen nach § 12 Abs. 3 Solvy V Aufrechungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergelenden Aufrechungsverein-barungen nach § 12 Abs. 3 Solvy V Aufgliederung sämtlicher KSA- Pealstonen nach Riskogsverbinden V Solvy S	030	Außerbilanzielle Adressenausfall-											
Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfätigen produktibergreifenden Aufrechnungswerein-barungen nach § 12 Abs. 4 SolvV Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten 70% 20% 35% 50% 4arunter-Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurleilung einer anerkannten Rälingagentur unter-Überfällige Positionen	040	Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach §											
berticksichtigungsfähigen produktigergefehenen Aufrechnungsverein-barungen nach § 12 Abs. 4 SolW Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten 707 0% 10% 20% 20% 10% 20% 10% 10% 10% 10% 10% 10% 10% 10% 10% 1	050	risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach §											
Positionen nach Riskogewichten 707 0% 708 10% 709 20% 709 35% 709 4 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7 7	060	berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsverein-barungen											
10% 20% 20% 20%		Positionen nach											
20% 35% 50%													
110 50% darunter: Überfällige Positionen 130 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur 140 Durch Gewerbeimmobillen besicherte Positionen 150 75% 160 100% darunter: Überfällige Positionen 160 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur 170 darunter: Überfällige Positionen 180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur 190 Durch Immobilien besicherte Positionen 200 150% darunter: Überfällige Positionen 201 darunter: Überfällige Positionen 202 200%													
darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen 135 70% 146 100% 150 75% 160 100% 170 darunter: Überfällige Positionen 180 Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur 190 Durch Immobilien besicherte Positionen 191 Durch Immobilien besicherte Positionen 201 darunter: Überfällige Positionen 202 darunter: Überfällige Positionen							1						
Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen 145 70% 150 75% 160 100% 170 darunter. Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien besicherte Positionen Durch Immobilien besicherte Positionen 210 darunter. Überfällige Positionen 221 darunter. Überfällige Positionen													
141		Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
150 75%	140												
160 100% darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien besicherte Positionen 100 darunter: Überfällige Positionen 210 darunter: Überfällige Positionen 220 200%	145												
darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien besicherte Positionen 100 darunter: Überfällige Positionen 210 darunter: Überfällige Positionen 220 200%	150	75%											
Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien besicherte Positionen 190 150% 101 darunter: Überfällige Positionen 202 200%													
Durch Immobilien Durch Immobilien Desicherte Positionen		Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
Desicherte Positionen	161												
210 darunter: Überfällige Positionen 220 200%		besicherte Positionen											
220 200%													
	220	200%											

			dung über KS s- bzw. Finar			Verbriefu	ngspositio	onen				KSA Q5 Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:	inte	rnationale anisationen	1	nummer:		Prüfziffer:		Übe	ergeordnetes Internehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
				0							in Mid	Euro
		KSA-Bem Kreditrisikon We		(-) Wertberichti (1) gem	KSA-Bemi Kreditrisik	Kreditrisi	kominderung KS		mit Substitu		n bei den	KSA-Beme Kreditrisikon
		emessungsgrundlage vor Berücksichtigu kominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 Sol Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: Nac Marktbewertun b	gungen und Rückst neldeten KSA-Positi	essungsgrundlage vominderungstechni	Kreditd Inkongr		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sonstige Aı Lebensve Inkongruenzer	Substitutio	onseffekte	ssungsgrundlage n
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. 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 Kredinsikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	ewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 +10
010	Gesamtsumme										<u>l</u>	
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle											
030	Adressenausfall- risikopositionen Nichtderivative Geschäfte mit											
040	Sicherheitennachschüssen 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
140	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170 180	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
190	anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

				SA-Positionen ohne nzholding-Gruppe)	Verbriefu	ngspositi	ionen					KSA Q5 Blatt 2
	KSA-Forderungsklasse:		ationale sationen	Inst	itutsnummer:		Prüfziffer:		ÜŁ	oergeordnetes Unternehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
											in Mic	Euro
		Auswi berücksicht	rkungen auf o Bemessungs igungsfähige	ungstechniken mit die Höhe der KSA- sgrundlage: finanzielle Sicherheiten enden Methode	KSA-Bem	Adressen	ederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen r	ach KSA-		Risikoge	
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 Sov V	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsisktoren für berücksichligungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsisktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kredtriskominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17-	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position				-					0,5*18		Übertrag ÜB Meldebogen
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160 170	100% darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200% Sanstiga Risikagawishta											

			dung über KS ts- bzw. Finan			Verbriefu	ngspositi	onen				Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:		nstitute	_	nummer:		Prüfziffer:		Üb	ergeordnetes Internehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
											in Mic	Euro
		KSA-Beme: Kreditrisikom Wer		(-) Wertberichtig (1) gema	KSA-Bemer Kreditrisika		KS	gstechniken A-Bemessu		itionseffekte gen	n bei den	KSA-Bemes Kreditrisikom
		ssungsgrundlage v inderungstechnike tberichtigungen ur	darunter: Na Marktbewertun b	ungen und Rücks eldeten KSA-Posit	ssungsgrundlage v ominderungstechn	berücksid fähige Gar Kreditd Inkongr	rleistungen chtigungs- rantien und lerivate: uenzen- e Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistu sonstig Leben Inkongruen	Substitutio	onseffekte	sungsgrundlage n inderungstechnike
		KSA-Bemessungsgrundläge vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmeithode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditriskominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		01	02	03	04=01+03	05	06	07	08	09 = 05+ 06+07+08	10	11=04+09 +10
010	Gesamtsumme									00107100		110
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach §											
030	12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten											
070 080	0% 10%											
090	20%											
100	35%											
110 120	50% darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien											
	besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen 200%											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

KSA Q6 Blatt 2 41. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe) Übergeordnetes Unternehmen: KSA-Forderungsklasse: Prüfziffer Institute Institutsnummer Stand Ende: Sachbearbeiter/in: in Mio Euro Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode Aufgliederung der außerbilanziellen dressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung Kreditrisikominderungstechniken Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopseifonen (HE) nach § 188 SolvV KSA-Positionswert nach § 48 SolvV Eigenkapitalanforderungen (-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sichemeiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge (-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwarkungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sicherungsinstrumente 20% 100% 20=15-16 15=11+12 +13 0,8*17-0,5*18 Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position Bilanzielle Adressenausfallrisiko-positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle Adressenausfall-risikopositionen Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsverein-barungen nach § 12 Abs. 4 SolvV Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Risikogewichten 0% 10% 20% 35% 110 50% darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung eine anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen 145 70% 75% 160 100% darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur 150% darunter: Überfällige Positionen Sonstige Risikogewichte

		dung über KS/ ts- bzw. Finan			Verbriefu	ngspositio	onen				KSA Q7 Blatt 1	
	KSA-Forderungsklasse:	von Kredit	instituten emittierte gedeckte		nummer:		Prüfziffer:			ergeordnetes		
	ū	Schuldy	erschreibungen							Internehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
		1									in Mic	Euro
		KSA-Bem Kreditrisikor We		-) Wertbericht (1) gen	KSA-Bem Kreditrisil	Kreditrisil		gstechniken A-Bemessu		itionseffekte gen	n bei den	KSA-Beme Kreditrisikor
		əmessungsgrundlage vor Berücksichtigu kominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 Sol Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: Nac Marktbewertung be	igungen und Rückste neldeten KSA-Positi	essungsgrundlage v kominderungstechnil	Kreditd Inkongr		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sonstige Aı Lebensve Inkongruenzer	Substitutio	onseffekte	ssungsgrundlage na ninderungstechniker
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	ewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle											
030	Adressenausfall- risikopositionen Nichtderivative Geschäfte mit											
040	Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Dariehens- 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											
070 080	0% 10%											
090	20%											
100	35%											
110	50% darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150% darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

		(Instituts-	bzw. Finar	A-Positionen ohne zholding-Gruppe)	Verbriefur	ngspositio	onen					KSA Q7 Blatt 2
	KSA-Forderungsklasse:	geo	tituten emittierte leckte schreibungen	Inst	titutsnummer:		Prüfziffer:		ÜI	oergeordnetes Unternehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	arbeiter/in:		Telefon:			
	. manazioramy arappor						ı.				in Mi	o Euro
		Ausw Bemessung	irkungen auf o gsgrundlage: t	ungstechniken mit die Höhe der KSA- perücksichtigungsfähige nach der umfassenden ode	KSA-Beme	Adressen	iederung der nausfallrisikop rsionsfaktore	positionen r	ach KSA-		Risikogev	
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungstaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 Solv V	 (-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge 	Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwarkungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sichenungsinstrumente	KSA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kredtrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position									0,5 16		Übertrag ÜB Meldebogen
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvY Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivie Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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%											
100	20% 35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160 170	100% darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen 200%											
220	Sonetigo Bisikogowichto											T

												KSA Q8 Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:	r <u> </u>	ternehmen	_	nummer:		Prüfziffer:			ergeordnetes Internehmen:		
	Institutsgruppe /			Stand		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:]	
	Finanzholding-Gruppe:			Ende:							in Mic	o Euro
		KSA-Bem Kreditrisikoı We		(-) Wertbericht (1) ger	KSA-Bem Kreditrisi	Kreditrisi		gstechniken A-Bemessu		utionseffekte gen	n bei den	KSA-Beme Kreditrisiko
		essungsgrundlage v minderungstechnike ertberichtigungen un	darunter: Nac Marktbewertun bı	igungen und Rückst meldeten KSA-Positi	essungsgrundlage v kominderungstechni	Kreditd Inkongr		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistu sonstige Leben: Inkongruen:	Substitution	onseffekte	essungsgrundlage na minderungstechnike
		KSA-Bemessungsgrundläge vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmeithode, SM oder IMM berechnet (a)	 (-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden 	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Hriedirisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von 4-Kredirisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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											
	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle Adressenausfall-											
030	risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Dariehens- 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											
	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsverein-barungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Risikogewichten											
070 080	0% 10%											
090	20%					-						
100	35%											
110	50% darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitātsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%					Ţ						
160	100%					-						
170	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210 220	darunter: Überfällige Positionen 200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

				A-Positionen ohne nzholding-Gruppe)	Verbriefu	ngspositi	onen					KSA Q8 Blatt 2
	KSA-Forderungsklasse:	r e	nehmen		tutsnummer:		Prüfziffer:			oergeordnetes Unternehmen:		
	Institutsgruppe /			Stand Ende:		Cookhoo	rbeiter/in:		Telefon:	,		
	Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende.		Sacribea	ibellei/iii.		releion.		in Mic	Euro
		Auswi Bemessung finanzielle	rkungen auf d jsgrundlage: b	ungstechniken mit die Höhe der KSA- perücksichtigungsfähige nach der umfassenden ode	KSA-Beme	Adressen	ederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen n	ach KSA-	-		Laro
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallrisikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Sicherheiten für berücks ichtigungsfährige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfähör für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position									0,5 16		Übertrag ÜB Meldebogen
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080	10% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160 170	100% darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen 200%											
230	Sonstige Risikogewichte											

KSA Q8

44. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)											KSA Q9 Blatt 1	
	KSA-Forderungsklasse:	gengeschäft	1	nummer:		Prüfziffer:		Üb	ergeordnetes Internehmen:			
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
		I									in Mid	Euro
		KSA-Bem Kreditrisikon We		(-) Wertberichti (1) gem	KSA-Bemi Kreditrisik	Kreditrisi	kominderung KS		mit Substitu		n bei den	KSA-Beme Kreditrisikon
		darunter: Nach der Laufzeitmet Marktbewertungsmethode, SM or berechnet (a) berechnet (a) emessungsgrundlage vor Berücksichtigu kominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 Sol Wertberichtigungen und Rücksteilungen		gungen und Rückst neldeten KSA-Positi	essungsgrundlage vominderungstechni	Kreditd Inkongr		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sonstige Au Lebensve Inkongruenzer	Substitution	onseffekte	ssungsgrundlage n
		KSA-Bemessungsgrundläge vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	berücksichtigungsfähige nsprüche sowie risicherungen: nbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle											
030	Adressenausfall- risikopositionen Nichtderivative Geschäfte mit											
040	Sicherheitennachschüssen 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
140	anerkannten Ratingagentur 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											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

				A-Positionen ohne nzholding-Gruppe)	Verbriefu	ngspositi	onen					KSA Q9 Blatt 2
	KSA-Forderungsklasse:		ngeschäft		itutsnummer:		Prüfziffer:			ergeordnetes Unternehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
		IZ	tole Heave be also								in Mic	Euro
		Auswi Bemessung	rkungen auf o sgrundlage: b	ingstechniken mit die Höhe der KSA- perücksichtigungsfähige nach der umfassenden ode	KSA-Beme	Adressen	ederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen n	ach KSA-		Risikogev	
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallirsikopositionen (HE) nach § 188 SolvV	 (-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge 	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfäktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kredirisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme									0,5 10		Übertrag ÜB Meldebogen
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position											molococycli
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
070	Risikogewichten 0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110 120	50% darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
140	besicherte Positionen											
145	70%											l
150 160	75% 100%											
	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

KSA Q9

		45. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)										
	KSA-Forderungsklasse:	durch	durch Immobilien besicherte Positionen				Prüfziffer:			ergeordnetes Internehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
				T							in Mic	Euro
		KSA-Beme Kreditrisikon We) Wertberichti (1) gem	KSA-Beme Kreditrisik	Kreditrisi	kominderunç KS	gstechniken A-Bemessu			n bei den	KSA-Bemer Kreditrisikom
		darunter: Nach der Laufzeitmet Marktbewertungsmethode, SM or Marktbewertungsmethode, SM or Berückschligungen und Flückstellungen und Rückstellungen und Rückstellungen		gungen und Rücks ıeldeten KSA-Posit	essungsgrundlage cominderungstechn	berücksid fähige Gar Kreditd Inkongr	rleistungen chtigungs- rantien und erivate: uenzen- e Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sonstige Au Lebensve Inkongruenzer	Substitution	onseffekte	ssungsgrundlage r ninderungstechnike
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter: 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 Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	ewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsverein-barungen nach § 12 Abs. 4 SolvV											
	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach											
070	Risikogewichten 0%											
080	10%											
090	20%											
100	35%											
110 120	50% darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitātsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien											
190	besicherte Positionen											
200	150% darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											
230	Sonstige Risikogewichte		0.1									
		(a) einschl	ießlich Aufrechnun	gspositioner	nach § 12 So	olvV, deren N	lettobemessu	ngsgrundlage	nach der La	utzeitmethod	e,	Seite 1

KSA Q10 Blatt 2 45. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe) durch Immobilien Übergeordnetes Unternehmen: KSA-Forderungsklasse: Institutsnummer Prüfziffer besicherte Positionen Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe: Stand Ende: Sachhearheiter/in: Telefon: in Mio Euro Kreditrisikominderungstechniken mit Auswirkungen auf die Höhe der KSA-Bemessungsgrundlage: berücksichtigungstähige finanzielle Sicherheiten nach der umfassenden Methode Aufgliederung der außerbilanziellen Adressenausfallrisikopositionen nach KSA-Konversionsfaktoren nach § 50 SolvV KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken Risikogewichteter Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallirsikopositionen (HE) nach § 188 SolvV KSA-Positionswert nach § 48 SolvV Eigenkapitalanforderungen (-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge KSA-Positionswert nach § 24 SolvV (-) Betragsanpassung des Wortes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfaktor für Sichenungsfaktor für Sichenungsinstrumente 50% 100% 0% 20% 20=15-16-15=11+12 12 13 0,8*17-0,5*18 14 16 17 18 19 21 22 +13 Übertrag ÜB Meldebogen Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA-Positionen nach Art der Position Bilanzielle
Adressenausfallrisikopositionen und
Aufrechnungspositionen nach §
12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle Adressenausfall-risikopositionen Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV Derivative Adressenausfall-risikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsverein-barungen nach § 12 Abs. 4 SolvV 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 darunter: Überfällige Positionen 200% Sonstige Risikogewichte 230 Seite 2

		46. Meld	dung über KS s- bzw. Finar	A-Positio	nen ohne -Gruppe)	Verbriefu	ngspositio	onen				KSA Q11 Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:	tmentanteile	1	nummer:		Prüfziffer:		Üb	ergeordnetes Internehmen:			
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
		ı		-							in Mic	Euro
		KSA-Bem Kreditrisikon We		(-) Wertberichti (1) gem	KSA-Bemi Kreditrisik	Kreditrisi	kominderung KS		mit Substitu		n bei den	KSA-Beme Kreditrisikon
		darunter: Nach der Laufzeitmet Marktbewertungsmethode, SM or Berücksteinet (a) berechnet (a) ernessungsgrundlage vor Berücksichtigu kominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 Sol Wertberichtigungen und Rücksteilungen		gungen und Rückst neldeten KSA-Positi	essungsgrundlage v cominderungstechn	Kreditd Inkongr		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistung sonstige Au Lebensve Inkongruenzer	Substitutio	onseffekte	ssungsgrundlage n ninderungstechnike
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bernessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kredtrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	ewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle											
030	Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
140	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170 180	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
190	anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

		46. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)										KSA Q11 Blatt 2
	KSA-Forderungsklasse: Investmentanteile				nstitutsnummer: Prüfziffer: Übergeordne Unternehm							
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:		in Mi	- Fure
		Auswi	rkungen auf o Bemessungs igungsfähige	ingstechniken mit lie Höhe der KSA- grundlage: finanzielle Sicherheiten enden Methode	KSA-Beme	Adressen	iederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen r	ach KSA-	_		Euro
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallriskopositionen (HE) nach § 188 SolvV	 (-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge 	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungstaktoren für benücksichtigungstähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungstäktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kredirisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA-											Übertrag ÜB Meldebogen
	Positionen nach Art der Position Bilanzielle											
020	Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
070 080	0% 10%									_		
090	20%											
100 110	35% 50%											
120	darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

KSA Q11

47. Meldung über KSA-Positionen ohne Verbriefungspositionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)											KSA Q12 Blatt 1	
	KSA-Forderungsklasse:	Ò	eiligungen	1	nummer:		Prüfziffer:			ergeordnetes Internehmen:		
]					,	mememmen.		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
				€					in N			Euro
		KSA-Beme Kreditrisikon We		Wertberichti (1) gem	KSA-Beme Kreditrisik	Kreditrisi	kominderunç KS		mit Substitungsgrundlag		n bei den	KSA-Beme Kreditrisikon
		darunter. Nach Marktbewertungs berr sungsgrundlage vor nderungstechniken (berichtigungen und		gungen und Rückst eldeten KSA-Positi	essungsgrundlage vominderungstechni	berücksid fähige Gar Kreditd Inkongr	rleistungen chtigungs- cantien und erivate: uenzen- e Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleistu sonstige Leben Inkongruen	Substitution	onseffekte	ssungsgrundlage n ninderungstechnike
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	 (-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeideten KSA-Positionen gebildet wurden 	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von HKSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von HKSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von HKSA-Bemessungsgrundlage von Berücksichtigung von HKSA-Bemessungsgrundlage von Berücksichtigung von HKSA-Bemessungsgrundlage von Berücksichtigung von HKSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von HKSA-Bemessungsgrundlage von HKSA-Bemessung	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kredtrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle Adressenausfall-											
0.50	risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen					•						
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen					•						
145	70%											
150	75%											
160 170	100% darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

			ıng über Ks bzw. Fina	fungspositionen						KSA Q12 Blatt 2		
	KSA-Forderungsklasse:	Beteil	igungen	Insti	itutsnummer:		Prüfziffer:			oergeordnetes Unternehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
											in Mic	Euro
		Auswi berücksicht	rkungen auf o Bemessungs igungsfähige	ungstechniken mit die Höhe der KSA- sgrundlage: finanzielle Sicherheiten enden Methode	KSA-Beme	Adressen	ederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen r	ach KSA-		Risikoge	
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwarkungsfaktor 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 Laufzeitanpassungsfäktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditriskominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme									-,- 10		Übertrag ÜB Meldebogen
030	Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Positionen nach Art der Positionen Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV											
060	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsverein-barungen nach § 12 Abs. 4 SolvV Aufgliederung sämtlicher KSA-											
	Positionen nach Risikogewichten											
070	0%											
080	10% 20%											
100	35%											
110	50%											
120 130	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien											
	besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

			dung über KS ts- bzw. Finan			Verbriefu	ngspositi	onen				KSA Q13 Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:	·	ge Positionen	_	nummer:		Prüfziffer:			ordnetes		
									Untern	ehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
				Ŧ.							in Mic	Euro
		KSA-Bem Kreditrisikon We) Wertberichti (1) gem	KSA-Beme Kreditrisik	Kreditrisi	kominderunç KS	gstechniken A-Bemessu			n bei den	KSA-Berne Kreditrisikon
		essungsgrundlage v ninderungstechnike rtberichtigungen ur	darunter: Na Marktbewertun b	gungen und Rücks eldeten KSA-Posit	essungsgrundlage o	berücksid fähige Gar Kreditd Inkongr	rleistungen chtigungs- rantien und erivate: uenzen- e Beträge	Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleist sonstig Leben Inkongruen	Substitutio	onseffekte	ssungsgrundlage n ninderungstechnike
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kredtrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. 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 Berücksichtgung von Kreditiskominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kredtrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
140	besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

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

				SA-Positionen ohne nzholding-Gruppe)	Verbriefu	ngspositi	ionen					KSA Q13 Blatt 2
	KSA-Forderungsklasse:	sonstige	Positionen	Insti	itutsnummer:		Prüfziffer:			ergeordnetes Internehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
											in Mic	Euro
		Auswi berü	rkungen auf d Bemessungs cksichtigungs	ingstechniken mit die Höhe der KSA- grundlage: fähige finanzielle imfassenden Methode	KSA-Bem	Adressen	ederung der ausfallrisiko rsionsfaktore	positionen n	ach KSA-		Risikoge	
		Erhöhung der KSA-Bemessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallniskopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge	(-) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Sicherheiten für berücksichtigungsfähöge finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfähör für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditrisikominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	0,8*17- 0,5*18	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA-											Übertrag ÜB Meldebogen
	Positionen nach Art der Position											
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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											
	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%											
110 120	50% darunter: Überfällige Positionen											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170 180	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
190	anerkannten Ratingagentur Durch Immobilien											
200	besicherte Positionen 150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											

			dung über KS. ts- bzw. Finan			Verbriefu	ngspositi	onen				KSA Q14 Blatt 1
	KSA-Forderungsklasse:	Ò	ige Positionen	-	nummer:		Prüfziffer:			ordnetes		
	NOA i orderangonaose.	abo. ia	igo i ociliciion	ii lottotoi			T TOIL TOIL		Untern	ehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
											in Mic	Euro
		KSA-Bem Kreditrisiko We		(-) Wertbericht (1) ger	KSA-Bem Kreditrisi	Kreditrisi	kominderung KS		mit Substitu ngsgrundlag		n bei den	KSA-Beme Kreditrisiko
		essungsgrundlage ninderungstechnike rrberichtigungen ur	darunter: Na Marktbewertur b	igungen und Rücks neldeten KSA-Posit	essungsgrundlage kominderungstechn	Kreditd Inkongr		Berücksichti- gungsfähige finanzielle Sicherheiten	Als Gewährleist sonstig Leben Inkongruer	Substitutio	onseffekte	ssungsgrundlage n minderungstechnike
		KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kredtrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV) zzgl. Wertberichtigungen und Rückstellungen	darunter. Nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (1) gemeideten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 49 Abs. 2 SolvV)	Garantien	Kreditderivate	Finanzielle Sicherheiten: Einfache Methode	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzenbereinigte Beträge	(-) Gesamt- summe der Abgänge	Gesamt- summe der Zugänge	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kredtrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten
		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 Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV											
030	Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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% 20%											
100	35%											
110	50%											
120	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer											
130	anerkannten Ratingagentur Durch Gewerbeimmobilien											
140	besicherte Positionen											
145	70%											
150 160	75% 100%											
170	darunter: Überfällige Positionen											
180	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220 230	200% Sonstige Risikogewichte											
1												

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

				SA-Positionen ohne nzholding-Gruppe)	Verbriefu	ngspositi	onen					KSA Q14 Blatt 2
	KSA-Forderungsklasse:	überfällige Pos	sitionen	Insti	tutsnummer:		Prüfziffer:		Ü	oergeordnetes Unternehmen:		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbear	beiter/in:		Telefon:			
	3 - 1									,	in Mic	Euro
		Auswirkung Ben berücksic	gen auf d nessungs htigungs	ingstechniken mit die Höhe der KSA- grundlage: fähige finanzielle imfassenden Methode	KSA-Bem	Adressena	ederung der ausfallrisikop sionsfaktore	ositionen na	ach KSA-		Risikoge	
		Erhöhung der KSA-Bernessungsgrundlage durch den Wertschwankungsfaktor für Adressenausfallriskopositionen (HE) nach § 188 SolvV	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und	(·) Betragsanpassung des Wertes der finanziellen Sicherheiten durch Schwankungsfaktoren für berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten und Laufzeitanpassungsfäktor für Sicherungsinstrumente	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung aller Kreditriskominderungstechniken	0%	20%	50%	100%	KSA-Positionswert nach § 48 SolvV	Risikogewichteter KSA-Positionswert nach § 24 SolvV	Eigenkapitalanforderungen
		12	13	14	15=11+12 +13	16	17	18	19	20=15-16- 0,8*17-	21	22
010	Gesamtsumme Aufgliederung sämtlicher KSA- Positionen nach Art der Position									0,5*18		Übertrag ÜB Meldebogen
020	Bilanzielle Adressenausfallrisiko- positionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle Adressenausfall-											
	risikopositionen											
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Dariehens- 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											
070	Risikogewichten 0%											
080	10%											
100	20% 35%											
110	50%											
120	ŭ											
130	Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
140	Durch Gewerbeimmobilien besicherte Positionen											
145	70%											
150	75%											
160	100%											
170	darunter: Überfällige Positionen Ohne Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur											
190	Durch Immobilien besicherte Positionen											
200	150%											
210	darunter: Überfällige Positionen											
220	200%											

				ber KSA-Positionen . Finanzholding-Grup	pe)							KSA QV Blatt 1
KSA	A-Forderungsklasse:	Verbrief	ungen	Institu	itsnummer:		Prüf- ziffer:			bergeordnetes Unternehmen:		
Verl	oriefungsart:	Summe	nblatt			1]]]			
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:			
				1		·			J		in Mi	o Euro
		Gesar	-	tische Verbriefung: Auf das Portfolio angewandte Ireditrisikominderungstechn		Verbriefungs- positionen	(-) Wertber (5) :	KSA-B Kre		trisikominderun stitutionseffekte Bemessungs	en auf die	KSA-
		Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositionen	(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsbereinigte Beträge (a)	Um Währungsinkongruenzen berücksichtigungsähige berücksichtigungsähige Garranten und Kreditienvale	Nominalbetrag zurückbehaltener oder zurückerworbener Kreditbesicherung	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken und zzgl. Wertbenchtigungen und Rückstellungen	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen, die für die in Spalte (5) gemeldeten KSA-Positionen gebildet wurden	KSA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 238 SolvV)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzenbereinigte Beträge	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten sowie als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzenbereinigte Beträge	effekt Anwend Kredi minde technike KSA-Ber	itutions- e durch dung von itrisiko- erungs- en auf die messungs- ndlage Zuflüsse insge samt
		01	02	03	04	05	06	07=05+06	08	09	10	11
010	Gesamtsumme	 										
011	darunter: Wiederverbriefungspositionen											
020	Originator: Gesamtengagement											
030	Bilanzielle Adressenausfall-											
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											
102												
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen											
141	Verbriefungenesitionen ohne											
142	Wiederverbriefungspositionen											
150	Sponsor: Gesamtengagement											
160	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
170	Außerbilanzielle und derivative											

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

			dung übe ts- bzw. F								KSA QV
KSA	-Forderungsklasse:	Verbri	efungen	Instituts- nummer:		Prüf- ziffer:		Überge	ordnetes		
Verb	riefungsart:	Sumr	nenblatt] —] [
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:		
				_	Δ	ufgliederur	na der KS	۸.		in l	Mio Euro
		KSA. Kreditrisi	(-) Kreditı Methode: Sc	KSA-Beme	Bemessu von auße	ingsgrundla erbilanzielle A-Konvers	age aus S en Position	palte (14) nen nach	_		
		KSA-Bernessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	 (-) Kredirisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge 	KSA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungstechniken	0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%	KSA-Positionswert (§ 239 SolvV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 267 SolvV)	KSA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugspositionen
		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											
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										

					iber K v. Fina				ope)									KSA QV Blatt 3
KS	A-Forderungsklasse:	,	Verbri	efung	en				Instituts-			Prüf- ziffer:					rgeordnetes nternehmen:	
Ver	briefungsart:		Sumn	nenbla	itt]	0			_	ı	1		
	Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:							Stand Ende:		bearb	Sach- eiter/in:					Telefon:		
														S N	Zus		in Mic	Euro
			Auf	igliede	rung de	r KSA-	Positio	nswerte	e nach R	Risikoge	ewichter	1	Risikog	zuschlag z solvV) bei \ Ab	schlagsbet Erfassun	Aggregie	iigenkapita Ve	
					Mit Rat ätsstufe		4)		125	60%	Durc	hschau	Risikogewichteter KSA-Positionswert (§ 240 SolvV)	Zuschlag zum risikogewichteten KSA-Positionswert (§ 240 Solvt) bei Verstoß gegen die Sorgfaltsplitichten nach § 16a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)	rag auf den risikogewichte g einer Laufzeitunterdecku Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	Nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von KSA Verbriefung zu anderen Forderungsklässen	Aggregierte Kapitalanforderungen
		20%	40%	50%	100%	225%	350%	650%	mit Rating	ohne Rating		darunter: Zweitverlustpositionen in ABCP	swert (§ 240 SolvV)	A-Positionswert (§ 240 altspflichten nach § 18a s 3 und 5 KWG	Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten KSA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen	ohne Anwendung der 1gen	: Id dem Abgang von KSA derungsklassen	rderungen
		22	36	23	24	37	25	38	26	27	28	29	30	34	35	31	32	33
010	Gesamtsumme																	Übertrag ÜB Meldebogen
01	darunter: Wiederverbriefungspositionen																	Übertrag ÜB Meldebogen
020	Originator: Gesamtengagement																	
030	Bilanzielle Adressenausfall-																	
03	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																	
032	2 Wiederverbriefungspositionen										_							
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																	
07	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																	
072	Wiederverbriefungspositionen																	
080	Vorzeitige Tilgung																	
090	Investor: Gesamtengagement																	
09	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																	
100	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																	
10	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen																	
102	2 Wiederverbriefungspositionen																	
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen				-													
14	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen			L														
142	Wiederverbriefungspositionen																	
150	Sponsor: Gesamtengagement		-		_			-										
160	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																	
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																	

		51. Meldu	ıng übei	r IRBA-Po	sitionen	(Instituts	- bzw. Fir	nanzholdi	ng-Grupp	e)			IRBA QS
	IRBA-Forderungsklasse:	Summer (Anlage 3 N 54, 5	r. 52, 53,			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Übe	ergeordnetes nternehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja	,	ı					I				
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
					Kraditricika	ominderungs	tachnikan n	nit Substitutio	nnsaffaktan				in Mio Euro
		Interne	_		t	ei den IRBA		gsgrundlage		주ㅠ			
		Internes Ratingsystem	RBA-Bernessungsgrund Kreditrisikominderun		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistun	Substitution	onseffekte	RBA-Bemessungsgrundla editrisikominderungstect		IRBA-Positions	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bernessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(·) Gesamtsumme der Abgånge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kredfiriskominderungstechniken mit Substitutionselfekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme	A. 4-11-1		shee IDDA F			Danitian						
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aurgnederu	nig samu	cher IRBA-F	ositionerri	acii Ai t dei	Position						
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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	Aufgliederu											
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1	Aurgilederui	ng samuk	ner IRBA-P	ositionen, c	ile einer Ha	tingstule of	der einem R	ISIKOPOOI 2	igeoranet s	ina		
090 100	2 3												
110 120	4 5												
130 140	6 7												
150 160	8												
170 180	10 11												
190	12 13												
210 220	14 15												
230 240	16 17												
250 260	17 18 19												
270	20												Blatt 1
													Blatt 1

		51. Meldu	ng über	IRBA-Po	sitionen	(Instituts	bzw. Fir	nanzholdi	ng-Grupp	e)			IRBA QS
	IRBA-Forderungsklasse:	Summer (Anlage 3 N 54, 5	r. 52, 53,			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Übe	rgeordnetes nternehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja											
	Institutsgruppe/ Finanzholding-			Stand		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
	Gruppe:			Ende:					J				
		ā			Kreditrisiko	ominderungs bei den IRBA	techniken m	nit Substitutio	onseffekten n				in Mio Euro
		emes Ra	IRB A			Als				IRBA-E Kreditri			
		Internes Ratingsystem	-Bemessungsgrund reditrisikominderur		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistur	Substitution	onseffekte	3emessungsgrundl isikominderungstec		IRBA-Positions	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bernessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter. Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter. Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		er einem Risikopool tizierte Ausfallwahr- keit (%)	vV)	Laufzeitmethode, node, SM oder IMM et (b)	tien	nvate	ihige sonstige	e der Abgänge	der Zugänge	lung von seffekten	erbilanzielle isikopositionen		erbilanzielle isikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
280													
300	23												
310	25												
330													
350	28												
360													
380													
400	33												
410													
430	36												
440													
460 470													
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem												
	Gesamtsumme												
		Aufgliederur berücksicht	ng sämtlid igt werde	cher IRBA-P n	ositionen, o	lie Spezialfi	nanzierung	en sind und	nach § 97 \$	SolvV mit d	em einfach	en Risikoge	wicht
490	0%												
500													
520	daruntarı mit ainar Bastlaufzait												
530	90%												
550													
330													
560	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 Riskogewicht angewendet wird												
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen												

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

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

Residence Part Pa			51. Meld	lung über	IRBA-Position	en (Instit	uts- bzw.	Finanzho	olding-Grup	pe)							IRBA QS
Vental Continue Processing		IRBA-Forderungsklasse:	Summenb 3 Nr. 52,	latt (Anlage 53, 54, 55)	,		Institutsr	nummer:			Prüfziffer:			Überged Unterne	ordnetes ehmen:		
Production of the properties of the production of the properties in value Production of the properties in value Production of the properties in value Production of the properties Production of the production of the properties Production		Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja				-										
Prostriction with reference of the control of the c					Stand Ende:		Sachbear	rbeiter/in:			Telefon:						
13 14 15 16 17 18 19 20 21 22 23 24 25 26 26 27 27 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20			Kreditris	skominderun				/erlustquote	bei Ausfall	Default	Positi				Nachr		
13 14 15 16 17 18 19 20 21 22 23 24 25 26 26 27 27 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20			Schätzu Verlust Ausf Gewäh berücksi fähige Ga	ungen der quote bei fall: Als irleistung chtigungs- irantien und		rücksichtigu	ngsfähige Sic	cherheiten		Berücksichtig	onswertgewichtete durchso bei A	ositionswertgewichtete du	Risikogewichteter IRBA	Eigenkapit	Erw	(-) Wertberic	Anz
13 14 15 16 17 18 19 20 21 22 23 24 25 26 26 27 27 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20 20			30	Kred	Verwendung eigs Verlustquot Veewä berücksichtigu Anspri Lebensvi	Berücksichtigu Sich	IR	BA-Sicherh	eiten	gungsfähige Gewäh	chnittliche prognost wsfall (%)	ırchschnittliche Lau	۰۰-Positionswert (§ ۱	a lanforde run gen	vartete Verlustbetră; (§ 104 SolvV)	htigungen und Rücl	ahl der Kreditnehm
13 14 15 16 17 18 19 20 21 22 23 24 25 28 28 27			rrantien	litderivate	ner Schätzungen e bei Ausfall: Als ihrleistung ingsfähige sonstige iche sowie ersicherungen	ngsfähige finanzielle nerheiten	ndpfandrechtliche BA-Sicherheiten	ichtigungsfähige IRE achsicherheiten	ichtigungsfähige IRE rungsabtretung von Forderungen	rleistungen	izierte Verlustquote	fzeit in Tagen	34 SolvV)		у е	stellungen	er
Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen nach Art der Position Billarzeile Adressee- darführeinungspositionen und hig 12 Abs. 2 Solv Michtigk-violate Gaschäfte mit Sicherheiterwachschüssen sowie sonstige Persione, Duriehmet- duriederungspositionen und Auffreihungspositionen Auffreihungsposition			13	14			17			20	21	22	23	24	25	26	27
Billancielle Adresser- constantification and the process of the pr	010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB- Meldebogen			
Nichtderveilvie Geschäte mit Sicherheitenachschüsen sowle sonntige Pensions. Dariebens- Old und vergleichsen Geschäte über Wertpapier oder Waren und Auf schungspeatinonen nuch 12 Abs. 3 Sohw Aufrechnungspotitionen nuch 12 Abs. 3 Sohw Aufrechnungspotitionen nuch 13 Abs. 1 Sohw Aufrechnungspotitionen nuch 14 Abs. 1 Sohw Aufrechnungspotitionen nuch 15 Abs. 1 Sohw Aufselnungspotitionen nuch 16 Abs. 1 Sohw Aufselnungspotitionen nuch 17 Abs. 1 Sohw Aufselnungspotitionen nuch 18 Abs. 1 Sohw Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 18 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 19 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 19 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 20 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 21 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 22 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 23 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 24 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 25 Abs. 4 Sohw 26 Battingstute oder Ratingspool (s): 27 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 28 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 29 Aufselnungsvereinbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 20 Abs. 4 Sohw 20 Abs. 4 Sohw 20 Abs. 4 Sohw 20 Abs. 4 Sohw 21 Aufselnungsbarungsbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 22 Abs. 4 Sohw 23 Aufselnungsbarungsbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 24 Aufselnungsbarungsbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 25 Abs. 4 Sohw 26 Abs. 4 Sohw 27 Aufselnungsbarungsbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 28 Aufselnungsbarungsbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 29 Aufselnungsbarungsbarungen nach 5 12 Abs. 4 Sohw 20 Abs. 4 Abs. 4 Sohw 20 Abs. 4 Abs. 4 Sohw 20 Abs. 4 Ab	020	ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach §	Aufgliede	rung sämtli	cher IRBA-Position	en nach Art	t der Position	n									
Sicherheltennachschüssen sowis jonatise Parisons-, Dariehens- old und vergleichbare Geschäfte über Wertspiere oder Waren nach § 12 Abs. 3 SolvV Der Vertreichungspositionen und Aufrechungspositionen nach § 12 Abs. 13 SolvV Aufrechungspositionen nach § 12 Abs. 13 SolvV Aufrechungspositionen nach § 12 Abs. 13 Solv Thi IRBA-Positionen, die einer Risikoppot zugererinden Aufrechungsvereinbarungen rach § 12 Abs. 4 SolvV Aufgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopot zugererinden Ratingstufe oder Ra	030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
42 Abs. 1 SolvV Aufrechnungspositionen auch § 12 Abs. 1 SolvV 1.1 IRBA-Positionen, die einer Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV 1.1 IRBA-Positionen, die einer Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV Aufgliederung sämtlicher 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 3 10 3 110 4 120 5 130 6 140 7 150 8 160 9 170 10 10 110 10 110 10 110 1	040	Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen															
Description	050	ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach §															
Autgliederung sämtlicher IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind	060	berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen															
Ratingstufe oder Ratingpool (a):1 090 2 100 3 110 4 120 5 130 6 144 7 150 8 160 9 177 10 180 11 199 12 200 13 210 14 220 15 230 16 240 17 255 18	070	Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind:	Aufaliados	ung oömtlig	shor IDPA Docition	on die einer	- Potingstufe	ador sino	m Pisikanaal	zu goordnot	oind						
100 3 1 110 4 1 120 5 5 130 6 144 7 7 150 8 160 9 170 10 180 11 1 190 12 200 13 210 14 220 15 230 16 240 17 255 18		Ratingstufe oder Ratingpool (a):1	augueder	ung samulic	ner inde-Position	on, ule elliel	naungstufe	Juer eine	півікороої	zageoranet	ontu						
130	100	4															
150 8 160 9 170 10 180 11 199 12 200 13 210 14 220 15 230 16 240 17 255 18	130	5 6 7															
180 11 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1	150 160	8 9															
210	180 190	11 12															
230 16 240 17 250 18	210	14															
	230 240	17															
270 20	260	19															Blatt 3

		51. Melo	dung über	IRBA-Position	en (Institu	uts- bzw.	Finanzho	olding-Grup	ppe)							IRBA QS
	IRBA-Forderungsklasse:	Summent 3 Nr. 52,	olatt (Anlage 53, 54, 55)			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Überge	ordnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja		J						J						
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:			Telefon:						
									ı	ı	1			ı		in Mio Eur
		Kreditris	skominderun	gstechniken, die sic auswirken (ohne	h auf die pro Double Defa	gnostizierte \ault Effekte)	Verlustquote	e bei Ausfall	Double Default Effekte	Posit				Nach	richtliche An	gaben
		Schätzi Verlust Aust Gewäh berücksi fähige Ga	ung eigener ungen der tquote bei fall: Als nrleistung ichtigungs- arantien und tderivate	Ве	rücksichtigu	ngsfähige Si	cherheiten		Berücksich	onswertgewichtete durch bei	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderunger	щ	(-) Wertber	Ar
				Verwe	Ber	Sonstige I	berücksicht RBA-Sicherh	igungsfähige leiten	tigungsfä	schnittlich Ausfall (S	durchschi	3A-Positio	italanford	wartete \	ichtigung	ızahl der
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verfustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewicht ete durchschnittliche prognostizierte Verfustquote bei Ausfall (%)	nittliche Laufzeit in Tagen	onswert (§ 84 SolvV)	terungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
280	21	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
290 300 310 320 330 340 350 360 370 380 400 410 420 430 440 450 470	23 24 25 26 27 28 29 30 31 32 33 34 35 36 37 37															
	Gesamtsumme	Aufalieder	runa sämtlia	her IRBA-Position	en die Snez	ialfinanzieri	ungen sind	und nach 8 9	7 SolvV mit	dem einfac	hen Risil	conewich	nt			
490	0%	berücksic	htigt werde	n	,		J					J				
500																
510	daruntari mit ainar Bastlaufzait															
520	von weniger als 2,5 Jahren															
540																
550	250%															
560	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 erlin Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften															

		51a. Meld	ung übe	er IRBA-P	ositioner	(Institut	s- bzw. F	inanzhol	ding-Gru	ppe)		IF	RBA QSa
	IRBA-Forderungsklasse:	Summe (Anlage 3 53a, 5	Nr. 52a,			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Über	geordnetes ternehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein	ou,	J					ļ		Į.	!	
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
				· 			techniken m						in Mio Euro
		Intern	=				Bemessung	sgrundlage	n	₹ 5			
		Intemes Ratingsystem	RBA-Bemessungsgrur Kreditrisikominderu		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistun	Substituti	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrundlage nach E Kreditrisikominderungstechniken mit		IRBA-Position	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	RBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgånge	Gesamtsumme der Zugänge	RBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme												
020	12 Abs. 2 SolvV	Aufgliederu	ng samtli	cher IRBA-F	ositionen r	ach Art dei	Position						
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions., Dariehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechungspositionen 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												
080 090 100 110 120 130 140 150 160 170 180 190	Fatingpool (87) 3 4 5 6 7 8 9 10 11	Aufgliederu	gsamm	THE INDAPP	ositioner, c	in oner na	ingsture of	er enieni r	isikopou z	ageordinet	Sillu		
210 220 230 240 250 260 270	14 15 16 17 18 19												Blatt 1

		51a. Meld	ung üb	er IRBA-P	ositione	n (Institut	s- bzw. F	inanzhol	ding-Gru	ope)		II	RBA QSa
	IRBA-Forderungsklasse:	Summe (Anlage 3 53a, 5	Nr. 52a,			Instituts	nummer:		Prüfziffer:			geordnetes ternehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Nein		_							_		
	Konversionsfaktoren: Institutsgruppe/ Finanzholding-			Stand		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:]	
_	Gruppe:		I	Ende:]]]	in Mio Euro
		Inter			Kreditrisiko b	ominderungs bei den IRBA	techniken m -Bemessunç T	it Substituti gsgrundlage	onseffekten en	x –			
		Internes Ratingsystem	IRBA-Bernessungsgrund Kreditrisikominderun		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	ionseffekte	RBA-Bemessungsgrundli kreditrisikominderungsteci		IRBA-Positions	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgånge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berückslichtigung von Virgendinisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten 9.000 (m. 1971)	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
280	21	01	02	03	04	05	06	07	08	+08	10	11	12
290	22												
310 320	24 25												
330	26												
340 350	27 28												
360 370	29 30												
380 390	31 32												
400	33												
410 420	34 35												
430 440	36 37												
450	38												
460 470	39 40												
480	Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederu berücksicht	ng sämtlid igt werde	cher IRBA-P	ositionen, o	die Spezialf	inanzierung	en sind un	d nach § 97	SolvV mit	dem einfac	hen Risiko	gewicht
490	0%												
500	50%												
510 520	70% 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 Riskogewicht 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 Nettobernessungsgrundlage nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet werden

		51a. Me	51a. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Fin						ruppe)						IF	RBA QSa
	IRBA-Forderungsklasse:	Summenb 3 Nr. 52a	olatt (Anlage a, 53a, 55a)			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Überged Unterne	rdnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein														
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	arbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditrisk	kominderung	stechniken, die sich auswirken (ohne	auf die prog	gnostizierte V	/erlustquote	bei Ausfall	Double Default	P				Nachi	ichtliche An	in Mio Euro gaben
			ung eigener	auswirken (onne	Double Dela	uit Ellekte)			Effekte	ositions	Pog					
		Verlust Ausf Gewäh berücksi fähige Ga	ungen der duote bei fall: Als nrleistung ichtigungs- arantien und tderivate	Beri	ücksichtigur	ngsfähige Sid	cherheiten		Berücksichtigu	wertgewichtete durchsc bei Ar	itionswertgewichtete du	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwar	(-) Wertberichti	Anzah
				Verwe der berü	Berü	Sonstige b	erücksichtig BA-Sicherhe	iten	ngsfähi	hnittlici ısfall (S	chschi	Positio	lanford	ete Ve § 104	gunger	l der K
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüchte sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	onswert (§ 84 SolvV)	terungen	Erwarie te Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB- Meldebogen			
		Aufgliede	rung sämtlid	cher IRBA-Position	en nach Ar	t der Positio	on									
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV															
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
080	Ratingstufe oder	Aufglieder	rung sämtlic	her IRBA-Position	en, die eine	r Ratingstuf	fe oder eine	m Risikopo	ol zugeordi	et sind						
090	Hatingpool (a):1															
100 110	3															
120 130	5															
140 150	7 8															
160 170	9															
180	11															
190 200	12 13															
210 220	14 15															
230 240	16 17															
250 260	18 19															
270	20															Blatt 3

		51a. Mel	dung übe	er IRBA-Positio	nen (Inst	ituts- bzw	. Finanzh	olding-G	ruppe)						IF	RBA QSa
	IRBA-Forderungsklasse:		latt (Anlage , 53a, 55a)			Instituts	nummer:			Prüfziffer:				ordnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein	,													
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditrisk	ominderung	stechniken, die sich			'erlustquote	bei Ausfall	Double Default	2				Nachr	richtliche An	in Mio Euro gaben
		Verwendu	ung eigener ungen der	auswirken (ohne	Double Dela	uit Ellekte)			Effekte	ositions	Posi	_				
		Verlusto Ausfa Gewähi berücksio fähige Gai	quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate	Beri	ücksichtigun	igsfähige Sic	herheiten		Berücksic	wertgewichtete du	tionswertgewichte	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigen	m	(-) Wertbe	
				be d	<u> </u>	Sonstige b	erücksichtig	jungsfähige	htigungsf	chschnitt bei Ausfa	e durchs	RBA-Pos	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	richtigun	Anzahl der Kreditnehmer
				wendu er Verlu rücksic A Leb	nūcksic	IRI	BA-Sicherhe		āhige G	liche pr	chnittlic	itionsw	orderun	Verlusti 14 Solv\	gen und	r Kredit
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verfustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	3erücksichtigungsfähige IRBA Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRE Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verfustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	ert (§ 84 SolvV)	gen	xetrāge)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	nehmer
		13	14	ge Is		17	18	on IRBA-	20	중 21	22	23	24	25	26	27
280		10	1,4	15	10	"	10	13	20	21		20	24	25	20	Ei
300 310	23															
320	25															
340	27															
360	29															
380	31															
400																
420 430																
440 450																
460 470																
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		Aufglieder berücksich	ung sämtlic htigt werder	her IRBA-Position	en, die Spez	zialfinanzier	ungen sind	und nach §	97 SolvV m	it dem einfa	chen Ri	l sikogewi	icht	I		
490	0%		gc.uei													
500																
520	darunter: mit einer Restlaufzeit															
530	von weniger als 2,5 Jahren 90%															
540																
560	250% 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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		52. Meldu	ng über	IRBA-Po	sitionen	(Instituts	bzw. Fin	anzhold	ing-Grup	pe)			RBA Q1
	IRBA-Forderungsklasse:	Zentralregi	erungen			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Über	geordnetes ternehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja										l	
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
							echniken mi						in Mio Euro
		Interne	IR				Bemessung	gsgrundlage	n	IRB			
		Internes Ratingsystem	3A-Bemessungsgrund Kreditrisikominderung	-	Garantien und Kredit derivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrundlage nach E Kreditrisikominderungstechniken mit		IRBA-Positionsv	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	RBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgånge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme	Aufgliederu		har IDDA I	isi		Danisian						
020	12 Abs. 2 SolvV	Aurghederu	ng samu	ner inda-r	ositionen r	ach Art der	Position						
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- lund 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												
080 090 100 110 120 130 140 150 170 180 190 200 210 220 230	Hamppool (8): 3 4 5 6 7 8 9 10 11 12 13 14 15 16	Aufgliederu	g samtlic	her IRBA-P	ositionen, c	lie einer Ha	ingstufe oc	der einem F	isikopool 2	ugeordnet	sind		
240 250 260 270	18												Blatt 1

		52. Meldu	ıng übe	IRBA-Po	sitionen	(Instituts	- bzw. Fir	nanzhold	ing-Grup	oe)			IRBA Q1
	IRBA-Forderungsklasse:	Zentralregi	ierungen			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Über	geordnetes ernehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Ja		ı					J 1		J		
	Konversionsfaktoren: Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
		_				minderungs ei den IRBA							in Mio Euro
		nternes	IRB/							IRBA Kredit			
		Internes Ratingsystem	\-Bemessungsgrunc \reditrisikominderun		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	-Bemessungsgrundl risikominderungstec		IRBA-Positions	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgånge	Gesamtsumme der Zugänge	HBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionserfekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
280	21	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
290	22 23												
310 320	24 25												
330 340	26 27												
350	28												
360 370	29 30												
380 390	31 32												
400 410	33 34												
420	35 36												
430 440	37												
450 460	38 39												
470	40												
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederu berücksicht			ositionen, o	die Spezialfi	nanzierung	en sind un	d nach § 97	SolvV mit o	dem einfac	hen Risiko	gewicht
490	0%	_ J. GURDIUIII	.gerde										
500	50%												
510 520	70% darunter: mit einer Restlaufzeit			-									
530	von weniger als 2,5 Jahren 90%												
540	115%												
550	250%												
560	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 Riskogewicht 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

		52. Meld	lung über	IRBA-Position	Finanzho	lding-Gru	ippe)							IRBA Q1		
	IRBA-Forderungsklasse:	Zentralre	egierungen			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Überged Unterne	ordnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja				_										
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditrisl	kominderung	stechniken, die sich auswirken (ohne l	auf die prog	nostizierte V ult Effekte)	erlustquote	bei Ausfall	Double Default	Po				Nachi	richtliche An	in Mio Euro gaben
		Verwend	ung eigener ungen der						Effekte	sitionsv	Posit	_				
		Verlust Ausf Gewäh berücksi fähige Ga	quote bei fall: Als irleistung chtigungs- irantien und derivate		ücksichtigun	gsfähige Sic			Berücksichtigu	vertgewichtete durchsc bei Au	ionswertgewichtete du	Risikogewichteter IRBA-Positionswert	Eigenkapitalanforderungen	Erwari ((-) Wertberichti	Anzah
				Verwe der \ berüc	Berüc	Sonstige b	erücksichtig BA-Sicherhe	jungsfähige iten	ngsfāhi	nittlich Isfall (%	chschr	Positio	lanford	ete Ver § 104 S	gungen	l der Kı
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüchte sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtele durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	nswert (§ 84 SolvV)	erungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB- Meldebogen			
		Aufgliede	rung sämtlid	cher IRBA-Position	en nach Art	der Positio	n									
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV															
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
080	Ratingstufe oder	Autglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positione	en, die einer	Hatingstuf	e oder eine	m Risikopod	o zugeordn	et sind						
090) Hatingpool (a):1															
110	4															
120	6															
140 150	8															
160	10															
180 190	12															
200 210	13															
220	15															
240 250	17															
260 270																
I		ì														Blatt 3

		52. Meld	ung über	IRBA-Position	en (Institu	uts- bzw.	Finanzho	lding-Gru	ippe)							IRBA Q1
	IRBA-Forderungsklasse:	Zentraire	gierungen			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Überge	ordnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja		I												
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditrisk	cominderung	stechniken, die sich			'erlustquote	bei Ausfall	Double Default	79				Nachi	ichtliche An	in Mio Euro gaben
		Verwendu	ıng eigener ıngen der	auswirken (ohne l	Double Delai	uit Ellekte)			Effekte	sitionsv	Posit	71				
		Verluste Ausfa Gewäh berücksie fähige Ga	quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate	Beri	úcksichtigun	gsfähige Sic	herheiten		Berücksichtigu	vertgewichtete durchsc bei A	tionswertgewichtete du	Risikogewichteter IRBA-Positionswert	Eigenkapitalanforderungen	Erwar	(-) Wertbericht	Anzat
				Verwei der V berücl	Berüd		erücksichtig BA-Sicherhe	iten	ngsfähig	hnittliche	chschni	-Positior	lanforde	tete Verl § 104 S	gungen	l der Kra
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährheistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRE Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verfustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	nswert (§ 84 SolvV)	rungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahi der Kreditnehmer
								ş								
280		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
300 310	23															
320	25															
340	27															
360 370	29															
380																
400	34															
430	36															
440	38															
460																
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		Aufglieder berücksich	ung sämtlic ntigt werder	her IRBA-Positione	n, die Spez	ialfinanzier	ungen sind	und nach §	97 SolvV m	it dem einfa	chen Ris	ikogewi	cht			
490			J													
500																
520	daruntar mit einer Reetlaufzeit															
530																
540 550																
	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA-Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtligt werden															
570	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		52a. Meld	ung übe	er IRBA-P	ositioner	(Institut	s- bzw. Fi	inanzhol	ding-Gru	ppe)		II	RBA Q1a
	IRBA-Forderungsklasse:	Zentralregi	erungen			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Über	geordnetes ernehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein											
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
							echniken mi						in Mio Euro
		Interne	Ξ				Bemessung	gsgrundlage	n	IRB			
		Internes Ratingsystem	BA-Bemessungsgrundl Kreditrisikominderun	_	Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrundlage nach E Kreditrisikominderungstechniken mit		IRBA-Positionsv	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	RBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgånge	Gesamtsumme der Zugänge	RBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbila nzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme	Aufgliederu	na cämtlii	her IDBA-	ocitionen n	ach Art de	Docition						
020	12 Abs. 2 SolvV	Adignedera	ng samu		Ostroneri	acii Ait dei	rosidon						
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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												
080 090 100 110 120 130 140 150 180 190 200 210 220 230 240 250	Hatingpool (8): 2 3 4 5 6 7 8 9 10 11 12 13 14 15 16 17	Aufgliederur	g sämtlic	her IRBA-P	ositionen, c	lie einer Ra	ingstufe oc	der einem F	isikopool 2	ugeordnet	sind		
260	19												Blatt 1

		52a. Meld	lung übe	er IRBA-P	ositione	n (Institut	s- bzw. F	inanzhol	ding-Gru	ppe)		II.	RBA Q1a
	IRBA-Forderungsklasse:	Zentralregi	ierungen			Instituts	nummer:		Prüfziffer:			geordnetes ernehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein		_									
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:		1	Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
	аларро.] 2100.		J							in Mio Euro
		Inte			Kreditrisiko b	minderungs ei den IRBA	techniken m -Bemessunç	it Substitution	onseffekten n				
		Internes Ratingsystem	IRBA-Bemessungsgrundl Kreditrisikominderung	_	Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrundla Kreditrisikominderungstech		IRBA-Positionsv	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von 4. Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionselfekten 9. 4. 4. 4. 4. 4. 4. 4. 4. 4. 4. 4. 4. 4.	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfalirisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
280	21	01	02	03	04	05	06	07	08	+08	10	11	12
290 300 310 320 330 340 350 360 370 380 390 400 410 420 430 450 470	22 23 24 25 26 27 28 29 30 31 32 33 34 35 36 37 38 39 1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen (RBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
	Gesamounne	Aufgliederu	ng sämtlic	her IRBA-P	ositionen, o	die Spezialfi	nanzierung	en sind un	d nach § 97	SolvV mit o	dem einfac	hen Risiko	gewicht
490	0%	berücksicht	igt werde	n 									
500	50%												
510	70% darunter: mit einer Restlaufzeit												
520	von weniger als 2,5 Jahren 90%												
540	115%												
550	250%												
560	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 Riskogewicht 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 bereichnet werden Blatt 2

		52a. Mel	dung übe	er IRBA-Position	nen (Insti	tuts- bzw	. Finanzh	olding-Gr	uppe)				_		II	RBA Q1a
	IRBA-Forderungsklasse:	Zentraire	gierungen			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Übergeo Unterne	rdnetes hmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein		J		_				l l			J			
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				in Mio Euro
				stechniken, die sich auswirken (ohne l			erlustquote	bei Ausfall	Double Default Effekte	Positi				Nachr	ichtliche An	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio fähige Gar	ung eigener ungen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate		icksichtigun	gsfähige Sic	herheiten		Berücksichtig	onswertgewichtete durchs bei /	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzelt in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert	Eigenkapitalanforderungen	Enva	(-) Wertberich	Anze
				Verwe der berü	Berü	Sonstige b	erücksichtig BA-Sicherhe	ungsfähige iten	ungsfähi	chnittlicl	urchsch	A-Positio	alanford	rtete Ve (§ 104	tigunger	ıhl der K
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verfustquote bei Ausfall (%)	nittliche Laufzeit in Tagen	onswert (§ 84 SolvV)	erungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB- Meldebogen			
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aufglieder	rung sämtlic	cher IRBA-Position	en nach Art	der Positio	n									
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
080 090 100 110	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1 2 3 4	Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positione	n, die einer	Ratingstuf	e oder eine	n Risikopoo	ol zugeordn	et sind						
120	5 6															
140 150	7 8															
160 170 180	9 10 11															
190 200	12 13															
210 220	14 15															
230 240 250	16 17 18															
260 270	19 20															
										·						Blatt 3

		52a. Mel	ldung übe	r IRBA-Positio	nen (Insti	tuts- bzw	. Finanzh	olding-Gr	ruppe)						I	RBA Q1a
	IRBA-Forderungsklasse:	Zentralre	egierungen			Instituts	nummer:			Prüfziffer:				ordnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein														
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditrisk	kominderung	stechniken, die sich auswirken (ohne l	auf die prog Double Defa	nostizierte V ult Effekte)	erlustquote	bei Ausfall	Double Default Effekte	Positi				Nachi	ichtliche An	in Mio Euro gaben
		Schätzu Verluste Ausfa Gewäh berücksie fähige Ga	ung eigener ungen der quote bei all: Als arleistung chtigungs- urantien und derivate	Beri	úcksichtigun	gsfähige Sic	herheiten		Berücksichtig	onswertgewichtete durchso bei A	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert	Eigenkapitalanforderungen	Erwa	(-) Wertberich	Anza
				Verwe der \ berüc	Berüc		erücksichtig BA-Sicherhe		ıngsfāhi	chnittlich	ırchschr	\-Positio	alanford	rtete Ve (§ 104 S	tigungen	hi der Kı
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Austalt (%)	iittliche Laufzeit in Tagen	nswert (§ 84 SolvV)	erungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
280	21	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
290 300 311 321 330 341 351 361 370 380 391 400 411 420 431 444 450 470	22 23 24 25 26 27 27 28 29 30 31 32 33 34 35 36 37 38															
480	nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		Aufglieder berücksicl	ung sämtlic htigt werder	her IRBA-Positione	n, die Spez	ialfinanzier	ungen sind	und nach §	97 SolvV m	it dem einfa	chen Ris	ikogewi	cht			
490 500																
510	70%															
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren															
530 540																
550													ı			
560	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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		53. Meldu	ng über	IRBA-Po	sitionen	(Instituts	bzw. Fir	nanzhold	ing-Grup	pe)			IRBA Q2
	IRBA-Forderungsklasse:	Instit	ute			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Über	geordnetes ternehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja									I	l	
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
							echniken m						in Mio Euro
		Interne	⋾				Bemessung	gsgrundlage	n	Kre II			
		Intemes Ratingsystem	IRBA-Bernessungsgrundlage vor Berücksichtigung Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Ge	Cubatituti	onseffekte	IRBA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kredtrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten		5	
		system	essungs sikomin		Garantien und Kreditderivate	hrleistun gungsfäl	währleis	Substituti	oriseriekte	ssungsg ninderun		BA-Posi	
		Zug	grundlag derungst	Ma		nige	stung be Aı			rundlage gstechnil		tionswer	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	e vor Be echniker	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMN berechnet (b)			Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Ges	Gesa	nach B	dan Adress	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darı Adress
		ngstufe oder einem te prognostizierte / scheinlichkeit (%)	rücksich ı (§ 100	nach de tungsme berech	Gara	Kredito	ntigungs e	(-) Gesamtsumme der Abgånge	Gesamtsumme der Zugänge	arücksici Substitut	darunter: Außerbilanzielle ressenausfallrisikoposition	99 Solv	darunter: Außerbilanzielle ressenausfallrisikoposition
		der eine stizierte shkeit (%	tigung v SolvV)	r Laufze ethode, s anet (b)	Garantien	Kreditderivate	sfähige :	me der /	e der Zı	htigung v	ıßerbilar Ilrisikop	<	ıßerbilar Ilrisikop
		m Risiko Ausfallv	von	itmethod 3M oder			sonstige	bgänge	lgänge	/on <ten< th=""><th>darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen</th><th></th><th>darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen</th></ten<>	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen		darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		vahr 01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme									+00			
		Aufgliederu	ng sämtli	cher IRBA-F	ositionen n	ach Art dei	Position						
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV												
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
	Nichtderivative Geschäfte mit												
040	Sicherheitennachschüssen 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												
	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen												
060	produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
070	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem												
	Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme	A f = 1! = -1 =		har IDDA D	!4!	lia aines Da			Nail		a in d		
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1	Aufgliederu	ng samtiid	ner IHBA-P	ositionen, c	ile einer Ha	tingsture od	der einem F	isikopooi 2	ugeoranet	sina		
100	3												
110 120 130	5												
140	7												
160 170	10												
190	12												
200 210 220	14												
230	16												
250 260	18												
270	20												Blatt 1

		53. Meldu	ıng übe	r IRBA-Po	sitionen	(Instituts	- bzw. Fir	nanzhold	ing-Grup	pe)			IRBA Q2
	IRBA-Forderungsklasse:	Instit	ute			Instituts	nummer:		Prüfziffer:			geordnetes ernehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Ja									1		
	Konversionsfaktoren: Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
		7			Kreditrisiko b	minderungs ei den IRBA	techniken m -Bemessung	it Substituti gsgrundlage	onseffekten en				in Mio Euro
		Internes Ratingsystem	IRBA-Bemessungsgrund Kreditrisikominderun		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substitut	ionseffekte	IRBA-Bemessungsgrundl Kreditrisikominderungstec		IRBA-Positions	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditriskominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Auße rbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
280	21	01	02	03	04	05	06	07	08	+08	10	11	12
290	22												
300 310	23 24												
320 330	25 26												
340 350	27 28												
360	29												
370 380	30 31												
390	32												
400 410	33 34												
420 430	35 36												
440	37												
450 460	38 39												
470	40												
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederu berücksicht	ng sämtlid	cher IRBA-P	ositionen, o	lie Spezialf	inanzierung	en sind un	d nach § 97	SolvV mit	dem einfac	hen Risiko	gewicht
490	0%	Joi WORSIUIII	.gr werde										
500	50%												
510	70%												
520 530	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren 90%												
540	115%												
550	250%												
560	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 Riskogewicht 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

		53. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzhol						lding-Gru	ippe)							IRBA Q2
	IRBA-Forderungsklasse:	Inst	itute			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Übergeo Unterne	rdnetes hmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja														
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditrisk	cominderung	stechniken, die sich auswirken (ohne I	auf die prog Double Defa	gnostizierte V iult Effekte)	erlustquote l	pei Ausfall	Double Default Effekte	Posi				Nachr	ichtliche An	in Mio Euro gaben
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio fähige Gar	ing eigener ingen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate		ücksichtigun	igsfähige Sicl	herheiten			tionswertgewichtete durchs bei /	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwa	(-) Wertberich	Anze
				Verw der beri	Beri	Sonstige b	erücksichtig BA-Sicherhe	ungsfähige iten	ungsfäl	chnittlic	urchsch	A-Posit	alanfor	rtete V (§ 104	tigunge	thi der i
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüchte sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtele durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	hnittliche Laufzeit in Tagen	ionswert (§ 84 SolvV)	derungen	Erwarte te Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB- Meldebogen			
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aufglieder	rung sämtlid	cher IRBA-Position	en nach Art	der Position	n									
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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	Aufalieder	ung sämtlic	her IRBA-Positione	n die einer	Ratingstufe	oder einer	n Risikonoo	al zugeordn	et sind						
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1		9		.,											
090 100	2															
110	4															
130	6															
140 150	7 8															
160 170	9 10															
180 190	11 12															
200 210	13 14															
220 230	15 16															
240 250	17 18															
260	19															
270	20											l				Blatt 3

		53. Meld	ung über	IRBA-Position	en (Institu	ıts- bzw.	Finanzho	lding-Gru	ірре)							IRBA Q2
	IRBA-Forderungsklasse:	Inst	itute			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Überged Untern	ordnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja		ı						! !						
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				in Min Franc
		Kreditrisk	cominderung	stechniken, die sich auswirken (ohne [auf die prog Double Defa	nostizierte V ult Effekte)	erlustquote	bei Ausfall	Double Default Effekte	Positi				Nachi	ichtliche An	in Mio Euro gaben
		Schätzu Verluste Ausfi Gewäh berücksie fähige Ga	ing eigener ingen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate	Berü	icksichtigun	gsfāhige Sicl	herheiten		Berücksichtig	onswertgewichtete durchs bei A	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert	Eigenkapitalanforderungen	Erwa	(-) Wertberich	Anza
				Verwe der\ berüc	Berüc		erücksichtig BA-Sicherhe	iten	ıngsfāhi	chnittlich vusfall (%	ırchschn	۱-Positio	alanford	rtete Ver (§ 104 S	tigungen	hi der Kr
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquole bei Ausfall: Als Gewählneistung berück sichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	ittliche Laufzeit in Tagen	nswert (§ 84 SolvV)	erungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahi der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280 290 310 320 330 340 350 360 370 380 400 410 420 430 440 450 460 470	22 23 24 25 26 27 28 29 30 31 32 33 34 35 36 37 38															
480	nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
			ung sämtlic ntigt werder	her IRBA-Positione	n, die Spez	ialfinanzieru	ingen sind	und nach § 9	97 SolvV m	it dem einfa	chen Ris	ikogewi	cht			
490 500																
510	daruntari mit ainar Bastlaufzait															
530	von weniger als 2,5 Janren															-
540																
	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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		53a. Meld	ung übe	er IRBA-P	ositioner	(Institut	s- bzw. Fi	inanzhol	ding-Gru	ppe)		IF	RBA Q2a
	IRBA-Forderungsklasse:	Institu	ute			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Über	geordnetes ernehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein										!	
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
							echniken mi						in Mio Euro
		Interne	IR				Bemessung	sgrundlage	n	IRB			
		Internes Ratingsystem	BA-Bemessungsgrundl Kreditrisikominderung	-	Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrundlage nach E Kreditrisikominderungstechniken mit		IRBA-Positionsv	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	RBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgånge	Gesamtsumme der Zugänge	RBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
01	1. Gesamtsumme	Aufgliederu	na eämtli	cher IDBA-	ocitionen n	ach Art dei	Docition						
02	12 Abs. 2 SolvV	Adignedera	ing samu		Contonen	acii Ait dei	rosidon						
03	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
04	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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												
06	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
07	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
086 099 100 111 122 133 144 155 166 177 188 199 200 211 222 233	Hamigpool (a): 3 4 5 6 7 8 9 10 11 12 13 14 15 16	Aufgliederu	g samtlic	her IRBA-P	ositionen, c	lie einer Ha	ingstufe oc	der einem F	isikopool 2	ugeordnet	sind		
24 25 26 27	18 0 19												Blatt 1

			53a. Meld	ung übe	er IRBA-P	ositione	n (Institut	s- bzw. F	inanzhol	ding-Gru	рре)		I	RBA Q2a
		IRBA-Forderungsklasse:	Instit	ute			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Über Un	geordnetes ternehmen:	
		Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein		_					_		_		
		Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:]	
Г					J	Vraditrinika	ominderungs	toohnikon m	it Cubatituti	nnaeffaktan				in Mio Euro
			Inter			b	ei den IRBA	-Bernessun	gsgrundlage	n	T -			
			Internes Ratingsystem	IRBA-Bemessungsgrund Kreditrisikominderung	_	Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung Derücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	RBA-Bemessungsgrundla Kreditrisikomin derungstect		IRBA-Positionsv	
			Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Austallwahr scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionsefiekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
١.	280	21	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
	290 300 310 320 330 340 350 360 370 380 400 410 420 450 450 470	22 23 24 25 26 27 28 29 30 31 32 33 34 35 36 37 38 39 1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen iRBA-fleikloogswicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
			Aufgliederu berücksicht	ng sämtlic igt werde	her IRBA-P	ositionen, o	die Spezialf	inanzierung	en sind un	d nach § 97	SolvV mit	dem einfac	hen Risiko	gewicht
	190	0%												
	500 510	50% 70%												
	520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
,	530	90%												
	540 550	115% 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 Riskogewicht 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

		53a. Mel	dung übe	r IRBA-Position	en (Institi	uts- bzw.	Finanzho	lding-Gru	ірре)						II	RBA Q2a
	IRBA-Forderungsklasse:	Inst	itute			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Überged Unterne	rdnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein														
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	efon:				
		Kreditris	kominderung	gstechniken, die sich auswirken (ohne [auf die progr Double Defau	nostizierte Ve ult Effekte)	erlustquote b	ei Ausfall	Double Default Effekte	Pos				Nachi	ichtliche An	in Mio Euro gaben
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewäh berücksio fähige Ga	ung eigener ungen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate	Berû	cksichtigunç	gsfähige Sich	erheiten			itionswertgewichtete durchs bei	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapi	Erwa	(-) Wertberich	Anzı
				Verwer der Va berück	Berück	Sonstige b	erücksichtig BA-Sicherhe	iten	ungsfähig	chnittliche Ausfall (%)	urchschnit	A-Position	Eigenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	ntigungen u	Anzahl der Kreditnehmer
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfalt: Als Gewährleistung berücksichtigungstähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtele durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	tliche Laufzeit in Tagen	swert (§ 84 SolvV)	ungen	ustbeträge √V)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	ditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB- Meldebogen			
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aufglieder	rung sämtlic	ther IRBA-Positione	n nach Art c	der Position										
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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	Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positioner	n, die einer F	Ratingstufe	oder einem	Risikopool	zugeordne	t sind						
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1															
090 100	2 3															
110 120	4 5															
130 140	6 7															
150 160	8															
170	10															
180	11 12															
200	13 14															
220 230	15 16															
240 250	17 18															
260 270	19 20															
																Blatt 3

		53a. Mel	dung übe	r IRBA-Position	en (Instit	uts- bzw.	Finanzho	olding-Gru	ірре)						II	RBA Q2a
	IRBA-Forderungsklasse:	Inst	itute			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Überger Untern	ordnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein		ı						1						
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditris	kominderung	gstechniken, die sich auswirken (ohne I	auf die progi Double Defai	nostizierte Ve ult Effekte)	erlustquote i	oei Ausfall	Double Default Effekte	Posit				Nachr	ichtliche An	in Mio Euro gaben
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewäh berücksio fähige Gai	ing eigener ingen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate	Berü	icksichtigun	gsfähige Sich	nerheiten		Berücksichtigu	onswertgewichtete durchso bei A	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84	Eigenkapitalanforderungen	Erwai	(-) Wertbericht	Anza
				Verwe der v berüc	Berüc	Sonstige b	erücksichtiç BA-Sicherhe	gungsfähige eiten	ngsfāhig	hnittlich usfall (%	rchschn	-Position	alanforde	tete Ver (§ 104 S	igungen	hl der Kr
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	ittliche Laufzeit in Tagen	nswert (§ 84 SolvV)	ərungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
280	21	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
290 300 310 320 330 340 350 370 380 390 410 420 430 440 450 470	23 24 25 26 27 28 29 30 31 32 33 34 35 36 37 38															
	Gesamtsumme	Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positioner	n, die Spezia	alfinanzieru	ngen sind u	ind nach § 9	7 SolvV mit	dem einfac	hen Risi	kogewic	nt			
490	0%	perucksich	ntigt werder													
500																
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren															
530 540																
550																
560	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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		54. Meldu	ng über	IRBA-Po	sitionen	(Instituts	bzw. Fin	anzhold	ing-Grup	pe)			IRBA Q3
	IRBA-Forderungsklasse:	Mengenge	eschäft			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Über	geordnetes ernehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja									J	l	
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
					Kreditrisiko	minderungs	echniken mi	it Substitutio	onseffekten				in Mio Euro
		Internes	IR				bernessung	jsgi uriulaye		IRB Kred			
		Internes Ratingsystem	3A-Bemessungsgrundl Kreditrisikominderung	-	Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrundlage nach E Kreditrisikominderungstechniken mit		IRBA-Positionsv	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	RBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
01	1. Gesamtsumme	Aufgliederu	na eämtli	cher IDBA-	ocitionen n	ach Art da	Docition						
02	12 Abs. 2 SolvV	Adignedera	ing samu		Contonen	acii Ait dei	rosidon						
03	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
041	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
05	Derivative Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 1 SolvV												
06	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen nach § 12 Abs. 4 SolvV												
07	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
086 099 100 111 122 136 144 155 166 177 188 199 200 211 222 233 244	Harrigodo (8): 3 3 4 5 6 7 7 8 9 10 11 12 12 13 14 15 16 16 16 16 16 16 16 16 16 16 16 16 16	Aufgliederu	g samtlic	her IHBA-P	ositionen, c	lie einer Ha	ingstufe oc	der einem F	isikopool 2	ugeordnet	sind		
25i 26i 27i	18 0 19												Blatt 1

		54. Meldu	ıng über	IRBA-Po	sitionen	(Instituts	- bzw. Fir	nanzhold	ing-Grup	pe)			IRBA Q3
	IRBA-Forderungsklasse:	Mengeng	eschäft			Instituts	nummer:		Prüfziffer:			geordnetes ternehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja											
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
				· 	Kreditrisiko	minderungs	techniken m	it Substitution	onseffekten				in Mio Euro
		Interr	_		b	ei den IRBA	-Bemessung	gsgrundlage	n	ζ =			
		Internes Ratingsystem	RBA-Bemessungsgrund Kreditrisikominderun		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	RBA-Bemessungsgrundla editrisikominderungsteci		IRBA-Positions	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
280	21	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
290 300 310 320 330 360 370 380 400 410 420 430 440 450 460 470	22 23 24 25 26 27 28 29 30 31 32 33 34 35 36 37 38 39 40 1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederu berücksicht	ng sämtlic igt werde	her IRBA-P	ositionen, o	lie Spezialf	inanzierung	en sind un	d nach § 97	SolvV mit o	lem einfac	hen Risiko	ogewicht
490 500	0% 50%												
510	70%												
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
530	90%												
540 550	115% 250%			-									
	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 Riskogewicht 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

		54. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzhole						ding-Gruլ	ppe)							IRBA Q3
	IRBA-Forderungsklasse:	Mengen	geschäft			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Übergeo Unterne	rdnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja		_		_										
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditrisk	kominderung	gstechniken, die sich auswirken (ohne [auf die progi	nostizierte Ve ult Effekte)	erlustquote b	ei Ausfall	Double Default Effekte	Pos				Nachi	richtliche An	in Mio Euro gaben
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio fähige Gar	ing eigener ingen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate		icksichtigun	gsfähige Sich	nerheiten			tionswertgewichtete durchs bei A	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderunger	Erwa	(-) Wertberich	Anza
				Verv der	Ber	Sonstige b	erücksichtig BA-Sicherhe	ungsfähige iten	ungsfäl	chnittlio	urchscl	A-Posit	alanfor	rtete V (§ 104	tigunge	thi der
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfalt: Als Gewährleistung berücksichtigungstähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	hnittliche Laufzeit in Tagen	tionswert (§ 84 SolvV)	rderungen	Erwarie te Verfustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kredimehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme												Übertrag ÜB- Meldebogen			
		Aufglieder	rung sämtlid	cher IRBA-Positione	n nach Art	der Position										
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV															
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
	1.1 IRBA-Positionen, die einer															
0/0	Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme		- 10					Di il								
080	Ratingstufe oder	Autgliederi	ung samtiic	her IRBA-Positioner	n, ale einer	Hatingsture	oder einem	ніѕікорооі	zugeorane	t sina						
090	Hatingpool (a):1															
110	4															
120 130	5 6															
140 150																
160 170	9 10															
180 190																
200 210	13 14															
220 230	15 16															
240 250	17 18															
260 270	19															
0																Blatt 3

		54. Meld	lung über	IRBA-Positione	n (Institu	ts- bzw. F	inanzhol	ding-Gru _l	ppe)							IRBA Q3
	IRBA-Forderungsklasse:	Mengen	geschäft			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Überge	ordnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA-	Ja														
	Konversionsfaktoren: Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	arbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditrisl	kominderunç	gstechniken, die sich	auf die progi	nostizierte V	erlustquote b	oei Ausfall	Double Default	ס				Nachi	ichtliche An	in Mio Euro
		Verwendu	ung eigener	auswirken (ohne [Double Defai	ult Effekte)			Effekte	ositions	Pos			140011	ioritaiorio 7 tri	gubon
		Verlusto Ausfa	ungen der quote bei all: Als							wertgew	itionswe	Risikoge				
		berücksid fähige Gar	rleistung chtigungs- rantien und	Berü	icksichtigun	gsfähige Sich	herheiten		Berücks	ichtete c	rtgewich	wichtete	Eige		(-) Wert	
		Kredito	derivate			0			Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert	Eigenkapitalanforderungen	Erwarte (§	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl
				Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücks	Sonstige D	erücksichtig BA-Sicherhe	iten	gsfähige	nittliche ı sfall (%)	hschnitt	ositions	anforderu	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	ungen ur	Anzahl der Kreditnehmer
		Gar	Kredit	ndung eigener Schätzu erfustquote bei Ausfall Gewährleistung ksichtigungsfähige son Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grun	Berücksichtigungsfähige IRBA Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRB Sicherungsabtretung von Forderungen	Gewähr	prognosi	liche Lau		ıngen	stbetrāgi vV)	nd Rücks	litnehme
		Garantien	Kreditderivate	ung eigener Schlustquote bei Aus Gewährleistung ichtigungsfähige Ansprüche sowie	gsfähige erheiten	dpfandr 8A-Siche	htigungs	chtigungsfähi rungsabtretur Forderungen	leistung	izierte V	ıfzeit in	(§ 84 SolvV)		Ψ	stellunge	-
				hätzun usfall: A g e sonst e sonst ngen	finanzie	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	sfähige I heiten	sfähige I etung v igen	3	erlustqu	agen	5			ň	
		13	14	ig lis gen	16	17		Von IRBA	20	21	22	23	24	25	26	27
280			14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	20	21
300 310	23															
320	25															
340	27															
360 370	29															
380	32															
410	34															
430	36															
440 450 460	38															
470	40															
480	1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem beinfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden:															
			ung sämtlic htigt werder	her IRBA-Positioner	n, die Spezi	alfinanzieru	ngen sind u	nd nach § 9	7 SolvV mit	dem einfac	hen Risi	kogewic	ht			
490			g													
510																
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren															
530	90%															
540																
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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

		55. Welau	ilg ubei	INDA-FU	Sitionen	(IIISIIIUIS	DZW. I II	lanznoiu	ing-arup	pe)	,		
	IRBA-Forderungsklasse:	Unterne	hmen			Instituts	nummer:		Prüfziffer:			geordnetes ernehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja											
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
)					I			ı	in Mio Euro
		5			Kreditrisiko b	minderungs ei den IRBA	echniken m Bemessung	it Substitution gsgrundlage	nseffekten n				
		Internes Ratingsystem	Ħ			bert				Kred IRB			
		Ratin	X-Ber Kredi		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung rücksichtigungsfähi	Als G			A-Ben itrisiko			
		gsyste	nessu trisiko		Garantien und Kreditderivate	/āhrlei ntigung	ewäh	Substituti	onseffekte	nessur		IRBA-	
		m	ngsgri min de		ate	stung _{Jsfāhiç}	rleistu			ngsgru		Positio	
		Zug	IRBA-Bernessungsgrundlage vor Berücksichtigung Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	Ма		T	Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche			IRBA-Bernessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten		IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	
		ner Ra geordn	e vor E echnik	darunter: nach der Laufzeitmethode, arktbewertungsmethode, SM oder IM berechnet (b)			berücksicht Ansprüche	(·) (a)	Ge	nach ken m	Adre	t nach	di Adre
		tingstu ete pr sch	Berück en (§	r: nac ertung		ζ.	ichtigu che	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	Berüc ft Subs	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	§ 99	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
		ngstufe oder einen e prognostizierte , scheinlichkeit (%)	sichti 100 S	h der jsmett erechn	Garantien	Kreditderivate	igsfå	summ	ımme	ksicht	r: Auß usfallr	NAOS	r: Auß usfallr
		r eine izierte keit (%	oly (_aufze node, s et (b)	tien	rivate	thige :	e der /	der Zı	gung	erbilar		erbilar
		m Ris Ausfa	von	itmeth SM od			sonsti	∆bgān	ugäng	von kten	nzielle osition		nzielle osition
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)		darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)			ge	ge .			en		en
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme												
		Aufgliederu	ng sämtli	cher IRBA-P	ositionen n	ach Art dei	Position						
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach §												
030	12 Abs. 2 SolvV Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens-												
040	und vergleichbare Geschäfte über Wertpapiere oder Waren												
	und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 3 SolvV												
050	Autrechnungspositionen nach §												
	12 Abs. 1 SolvV												
	Aufrechnungspositionen aus berücksichtigungsfähigen												
060	produktübergreifenden Aufrechnungsvereinbarungen												
	nach § 12 Abs. 4 SolvV												
	1.1 IRBA-Positionen, die einer Ratingstufe oder einem												
070	Risikopool zugeordnet sind: Gesamtsumme												
		Aufgliederu	ng sämtlic	her IRBA-P	ositionen, c	lie einer Ra	tingstufe o	der einem F	Risikopool 2	ugeordnet	sind		
080	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1												
100	2 3												
110 120	4 5												
130	6												
140	7												
160 170	9												
180 190	11 12												
200	13 14												
220	15												
230 240	16 17												
250 260	18 19												
270	20												Blatt 1

		55. Meldu	ıng übei	IRBA-Po	sitionen	(Instituts	- bzw. Fir	nanzhold	ing-Grup	pe)			IRBA Q4
	IRBA-Forderungsklasse:	Unterne	hmen			Instituts	nummer:		Prüfziffer:			geordnetes ernehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja											
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
				,	Kraditrisika	minderunge	techniken m	it Substituti	nnseffekten			,	in Mio Euro
		Inte			b	ei den IRBA	-Bemessung	gsgrundlage	n	-			
		Internes Ratingsystem	IRBA-Bemessungsgrund Kreditrisikominderun		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrundla Kreditrisikominderungsteci		IRBA-Positions	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
280	21	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
290 300 310 320 330 340 350 360 370 380 410 420 430 440 450 460 470	22 23 24 25 26 27 28 29 30 31 32 33 34 35 36 37 38 39 40 1.2 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederu berücksicht	ng sämtlic igt werde	her IRBA-P	ositionen, o	lie Spezialf	inanzierung	en sind un	d nach § 97	SolvV mit o	dem einfac	hen Risiko	gewicht
490 500	0% 50%												
510	70%												
520	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
530	90%												
540	115%												
560	250% 1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden 1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV												
	berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Riskogewicht angewendet wird 1.5 Veritätsrisikoposition:												
580	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, Marktbewertungsmeihode, SM oder IMM bereichnet werden Blatt 2

181

		55. Meld	ung über	IRBA-Positione	en (Institu	ıts- bzw. I	inanzho	lding-Gru	ppe)							IRBA Q4
	IRBA-Forderungsklasse:	Untern	ehmen			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Übergeo Unterne	rdnetes hmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja				_								'		
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				in Mio Euro
		Kreditrisk	cominderung	stechniken, die sich auswirken (ohne D	auf die progr Double Defar	nostizierte Vi ult Effekte)	erlustquote l	bei Ausfall	Double Default Effekte	Posit				Nachr	ichtliche Ang	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio fähige Gar	ing eigener ngen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate		icksichtigung	gsfähige Sich	nerheiten		Berücksichtig	onswertgewichtete durchs bei /	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzelt in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	емэ	(-) Wertberich	Anze
				Verwe der i berüt	Berü	Sonstige b	erücksichtig BA-Sicherhe	iten	ungsfähi	chnittlich	urchschr	A-Positic	alanford	rtete Ve (§ 104 §	tigunger	thi der K
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtele durchschnttliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	nittliche Laufzeit in Tagen	onswert (§ 84 SolvV)	erungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme			cher IRBA-Positione									Übertrag ÜB- Meldebogen			
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	Aurgileder	ung samulo	mer inda-Positione	m nach Art	der Position	1									
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
080	Ratingstufe oder	Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positione	n, die einer	Ratingstufe	oder einen	n Risikopool	zugeordne	et sind						
090	Ratingpool (a):1 2 3															
110 120	4 5															
130 140 150	6 7 8															
160 170	9 10															
180 190 200	11 12 13															
210 220	14 15															
230 240 250	16 17 18															
260 270	19 20															
Щ_																Blatt 3

		55. Meld	lung über	IRBA-Positione	en (Institu	ıts- bzw. I	inanzho	lding-Gru	ppe)							IRBA Q4
	IRBA-Forderungsklasse:	Unterr	nehmen			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Überged Untern	ordnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Ja														
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditrisl	kominderung	stechniken, die sich auswirken (ohne I	auf die progi Double Defau	nostizierte Voult Effekte)	erlustquote l	oei Ausfall	Double Default Effekte	Posit				Nachr	ichtliche An	in Mio Euro gaben
		Schätzu Verluste Ausfa Gewäh berücksie fähige Ga	ing eigener ingen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate		icksichtigung	gsfähige Sich	nerheiten		Berūcksichtigu	ionswertgewichtete durchso bei A	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Eigenkapitalanforderungen	Erwai	(-) Wertbericht	Anza
				Verwe der\ berüc	Berüc		erücksichtig BA-Sicherhe	iten	ngsfāhi	:hnittlich usfall (%	rchschr	,-Positio	alanford	rtete Ve (§ 104 S	igungen	nl der Kı
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüchte sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRB/ Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	nittliche Laufzeit in Tagen	nswert (§ 84 SolvV)	erungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
280 290 300 310 320 330 340 350 360 370 380 400 410 420 430 440 450 460 470	21 22 23 24 25 26 27 28 29 30 31 32 33 34 35 36 37 38 39 40															
	einfachen IRBA-Risikogewicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
			ung sämtlic htigt werder	her IRBA-Positione	n, die Spezi	alfinanzieru	ngen sind u	ınd nach § 9	7 SolvV mi	t dem einfac	hen Risi	kogewic	ht			
490 500 510 520 530 540 550	0% 50% 70% darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren 90% 115% 250%															
	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 Riskogewicht angewendet wird															
580	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

Blatt 4

		55a. Meld	ung übe	er IRBA-P	ositioner	(Institut	s- bzw. Fi	inanzhol	ding-Gru	ppe)		IF	RBA Q4a
	IRBA-Forderungsklasse:	Unterne	hmen			Instituts	nummer:		Prüfziffer:		Über	geordnetes ernehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein										!	
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
							echniken mi						in Mio Euro
		Interne	IR			_	Bemessung	sgrundlage	n	Kre			
		Internes Ratingsystem	BA-Bemessungsgrundl Kreditrisikominderung	-	Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrundlage nach E Kreditrisikominderungstechniken mit		IRBA-Positionsv	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	RBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgånge	Gesamtsumme der Zugänge	RBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbila nzielle Adressenausfallrisikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
010	1. Gesamtsumme	Aufgliederu	na eämtli	cher IDBA-	ocitionen n	ach Art dei	Docition						
020	12 Abs. 2 SolvV	Adignedera	ing samu		Contonen	acii Ait dei	rosidon						
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen												
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen sowie sonstige Pensions-, Darlehens- lund 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												
080 090 100 110 120 130 140 150 170 180 190 200 210 220 230 240	Hamppool (8): 3 4 5 6 7 8 9 10 11 12 13 14 15 16	Aufgliederu	g sämtlid	her IRBA-P	ositionen, c	lie einer Ra	ingstufe oc	der einem F	isikopool 2	ugeordnet	sind		
250 260 270	19												Blatt 1

	! -	55a. Meld	ung übe	er IRBA-P	ositioner	(Institut	s- bzw. F	inanzhol	ding-Gru	ope)			RBA Q4a
	IRBA-Forderungsklasse:	Unterne	hmen			Instituts	nummer:		Prüfziffer:			geordnetes ternehmen:	
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein											
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:		Telefon:				
Г				,	Vraditrinika	mindorunga	techniken m	it Cubatituti	anaeffekten			1	in Mio Euro
		Inte			b	ei den IRBA	-Bemessung	gsgrundlage	n	_			
		Internes Ratingsystem	IRBA-Bemessungsgrund Kreditrisikominderun		Garantien und Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige	Als Gewährleistung	Substituti	onseffekte	IRBA-Bemessungsgrundla Kreditrisikominderungstecl		IRBA-Positionsv	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr scheinlichkeit (%)	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SoVV)	darunter: nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (b)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfallrisikopositionen
	00	01	02	03	04	05	06	07	08	09=02+07 +08	10	11	12
2 3 3 3 3 3 3 3 3 3 4 4 4 4 4 4 4 4 4	80 21 90 22 90 23 10 24 20 25 30 26 40 27 50 28 60 29 70 30 80 31 90 32 90 32 90 33 10 34 20 35 30 36 40 37 50 38 60 39 70 30 12 Spezialfinanzierungen, die nach § 97 SolvV mit dem 80 elirfachen IRBA-Risikogswicht berücksichtigt werden: Gesamtsumme												
		Aufgliederu berücksicht	ng sämtlic iat werde	her IRBA-P	ositionen, o	lie Spezialfi	inanzierung	en sind un	d nach § 97	SolvV mit o	dem einfac	hen Risik	ogewicht
	90 0%												
	00 50% 10 70%												
	darunter: mit einer Restlaufzeit von weniger als 2,5 Jahren												
5	30 90 %												
	40 115%												
	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA- Positionen, die 60 nach § 85 Abs. 5 SohV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden 1.4 Vorleistungsrisikopositionen,												
5	die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und 70 sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Riskogewicht angewendet wird												
5	1.5 Veritätsrisikoposition: 80 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

		55a. Mel	dung übe	r IRBA-Positio	nen (Insti	tuts- bzw	. Finanzh	olding-Gr	uppe)				_		IF	RBA Q4a
	IRBA-Forderungsklasse:	Untern	nehmen			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Übergeo Unterne	rdnetes hmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein														
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				in Mio Euro
				stechniken, die sich auswirken (ohne			erlustquote	bei Ausfall	Double Default Effekte	Positi				Nachr	chtliche Ang	
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio fähige Gar	ing eigener ngen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate		icksichtigun	gsfāhige Sic	herheiten		Berücksichtigu	onswertgewichtete durchso bei A	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert	Eigenkapitalanforderungen	Erwa	(-) Wertbericht	Anza
				Verwe der \ berüc	Berüc	Sonstige b	erücksichtig 3A-Sicherhe	ungsfähige iten	ıngsfāhig	chnittlich .usfall (%	ırchschn	\-Positio	alanforde	rtete Ver (§ 104 S	igungen	hl der Kr
		Garantien	Kreditdenvate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquote bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüchte sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtele durchschnttliche prognostizierte Verlustquole bei Ausfall (%)	ittliche Laufzeit in Tagen	nswert (§ 84 SolvV)	rungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
010	1. Gesamtsumme	Aufalieder	una sämtlir	cher IRBA-Position	en nach Art	der Positio	n						Übertrag ÜB- Meldebogen			
020	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen und Aufrechnungspositionen nach § 12 Abs. 2 SolvV	3	-5													
030	Außerbilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen															
040	Nichtderivative Geschäfte mit Sicherheitennachschüssen 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															
080 090 100 110 120 130 140 150 160 170 180 190 200 210 220	Ratingstufe oder Ratingpool (a):1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 11 12 13	Aufglieder	ung sämtlic	her IRBA-Positione	die einer	Ratingstuf	der eines	n Risikopoo	al zugeordn	et sind						
230 240 250 260 270	16 17 18 19															Blatt 3

		55a. Mel	dung übe	r IRBA-Positio	nen (Insti	ituts- bzw	. Finanzh	olding-Gr	ruppe)						II	RBA Q4a
	IRBA-Forderungsklasse:	Unterr	nehmen			Instituts	nummer:			Prüfziffer:			Überged	ordnetes ehmen:		
	Eigene Schätzungen von Verlustquote bei Ausfall (LGD) und/oder IRBA- Konversionsfaktoren:	Nein		J												
	Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:			Stand Ende:		Sachbea	rbeiter/in:				Tele	fon:				
		Kreditrisk	kominderung	stechniken, die sich auswirken (ohne	auf die prog Double Defa	nostizierte V ult Effekte)	'erlustquote	bei Ausfall	Double Default Effekte	Posit				Nachi	ichtliche An	in Mio Euro gaben
		Schätzu Verluste Ausfa Gewäh berücksie fähige Ga	ung eigener ungen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate	Beri	ücksichtigun	gsfähige Sic	herheiten		Berücksichtig	ionswertgewichtete durchs bei	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert	Eigenkapitalanforderungen	Enva	(-) Wertberich	Anze
				Verwe der i	Berü		erücksichtig BA-Sicherhe		lungsfähi	chnittlich	lurchschr	A-Positic	talanford	artete Ve (§ 104.9	ntigunger	ahl der K
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquole bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	nittliche Laufzeit in Tagen	onswert (§ 84 SolvV)	erungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27
28 29 30 31 32 33 34 35 36 37 38 39 40 41 42 43 44 45 46 47	22 23 35 35 36 36 36 36 36 36 36 36 36 36 36 36 36															
10	berücksichtigt werden: Gesamtsumme															
		Aufglieder berücksich	ung sämtlic htigt werder	her IRBA-Positione	en, die Spez	ialfinanzier	ungen sind	und nach §	97 SolvV m	it dem einfa	chen Ris	sikogewi	cht			
49 50																
51 52	darunter: mit einer Restlaufzeit															
53	von weniger als 2,5 Janren															
54 55																
	1.3 Grundpfandrechtlich besicherte IRBA- Positionen, die nach § 85 Abs. 5 SolvV mit dem alternativen Risikogewicht von 50% berücksichtigt werden															
57	1.4 Vorleistungsrisikopositionen, die nach § 85 Abs. 7 SolvV berücksichtigt werden und sonstige, anderweitig nicht erfasste IRBA-Positionen, auf die ein Riskogewicht angewendet wird															
58	1.5 Veritätsrisikoposition: Gesamtheit der angekauften Forderungen															

Blatt 4

	56. Meld	ung über	IRBA-Position	nen (Insti	tuts- bzw. Finanzh	olding-Gruppe)			IRB <i>A</i>	QN
IRBA-Forderungsklasse:	Uni	liche Angab terklassen v Forderungsl			Institutsnummer:		Prūf.	ziffer:		
	99901	Verlustqu (LGD) u	chätzungen von uote bei Ausfall nd/oder IRBA- sionsfaktoren:							
		rgeordnetes nternehmen:			Institutsgruppe / Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:			

												in Mic	Euro
		ī,			Kreditrisiko	ominderungst bei den IRBA-	echniken m Bemessun	it Substitutio	nseffekten 1				
		Internes Ratingsystem	IRBA-Bemessungs Kreditrisikomin		berücksic fähige Gar	hrleistung chtigungs- rantien und derivate	Als Gewährleistung	Substitutio	onseffekte	IRBA-Bemessungsg Kreditrisikominderun		IRBA-Pos	
		Einer Ratingstufe oder einem Risikopool zugeordnete prognostizierte Ausfallwahrscheinlichkeit (%)	IRBA-Bernessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV)	darunter nach der Laufzeitmethode, Marktbewertungsmethode, SM oder IMM berechnet (a)	Garantien	Kreditderivate	Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	IRBA. Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kredirisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen	IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen
		01	02	03	04	05	06	07	08	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	I											
030	Gesamtsumme												
	Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Durch Immobilien besichert												
040	Gesamtsumme												
	Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Qualifiziertes revolvierendes Mengengeschäft												
050	Gesamtsumme												
	Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Kleine und mittlere Unternehmen												
060	Gesamtsumme												

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

	56. Meld	ung über	IRBA-Position	onen (Inst	ituts- bzw. Finanz	holding-Gruppe)				IRBA QN
IRBA-Forderungsklasse:	Unte	iche Angabe erklassen vo orderungskl			Institutsnummer:		Prüfzi	ffer:		
	99901	Verlustqui (LGD) un	hätzungen von ote bei Ausfall id/oder IRBA- ionsfaktoren:							
		rgeordnetes nternehmen:			Institutsgruppe / Finanzholding- Gruppe:		Stand Ende:			

															in Mio	Euro
		Kreditrisiko		echniken, die sid auswirken (ohne			Verlustquot	e bei Ausfall	Double Default Effekte					Nachri	chtliche Ar	igaben i
		Schätzu Verlusto Ausfa Gewähr berücksio fähige Gar	ing eigener ngen der quote bei all: Als rleistung chtigungs- rantien und derivate	Be	rücksichtigu	ngsfähige S	icherheiten			Positionswertgewichtete o	Positionswertgewich	Risikogewichtet	Eige	Erwar	(-) Wert	
				Verw Verlust berücks	ā	Sonstige b	erücksichtig BA-Sicherhe	jungsfähige iten	sichtigungs	durchschni bei Austa	tete durch	er IRBA-Po	nkapitalan	tete Verlus	berichtigur	Anzahl di
		Garantien	Kreditderivate	Verwendung eigener Schätzungen der Verlustquole bei Ausfall: Als Gewährleistung berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen	Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten	Grundpfandrechtliche IRBA-Sicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sachsicherheiten	Berücksichtigungsfähige IRBA- Sicherungsabtretung von Forderungen	Berücksichtigungsfähige Gewährleistungen	Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquote bei Ausfall (%)	Positionswertgewichtete durchschnittliche Laufzeit in Tagen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 84 SolvV)	Elgenkapitalanforderungen	Erwartete Verlustbeträge (§ 104 SolvV)	(-) Wertberichtigungen und Rückstellungen	Anzahl der Kreditnehmer
		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 revolvierendes Mengengeschäft															
050	Gesamtsumme															
	Forderungsklasse Mengengeschäft darunter: Kleine und mittlere Unternehmen															
060	Gesamtsumme															

Blatt 2

Fisikogewichteter IRBA-Positionswert nach § 84 SolvV 2	Positionswert nach § 84 SolvV 22				l	١				L						í	
Risikogewichteter IRBA-Positionswert nach § 84 SolvV Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustquole bei Ausfall (%) IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV Außerbilanzielle Adressenausfall-risikopositionen IRBA-Bemeissungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten Was pp. 19 Gesamtsumme der Zugänge Vergeterund Gesamtsumme der Zugänge Abgänge Agrandien der Krediterwate-Inkongerungsberüchen mit Mittige Garantien und Krediterwate-Inkongerungsberüchen mit Mittige Garantien und Kreditisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) Risikogeswichtete Verlustique Beträge Risikogeswichtete Verlustique Beträge Was pp. 19 Gesamtsumme der Zugänge Gesamtsumme der Zugänge Gesamtsumme der Abgänge Freditierwate-Inkongerungsberüchten (§ 100 SolvV) Risikogeswichtete Bryge Beträge Intermes Ratingsystem Intermes Ratingsystem Einer Ratingstufe zugeorhiken (§ 100 SolvV) Risikogeswichtete Gurchen (§ 100 SolvV) Risikogeswichtete (§ 100 SolvV) Risikogeswichtete Gurchen (§ 100 SolvV) Risikogeswichtete	Risikogewichteter IRBA-Positionswert nach § 84 SolvV Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierle Verfustquote bei Ausfall (%) Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierle Verfustquote bei Ausfall (%) IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV Budgerblanzielle Aufressenausfall-risikopositionen IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionserflekten IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionserflekten IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionserflekten IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (%) Als Gewahrteistung Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage von Berücksichtigung von Ber	RA-Forderungsklasse:	Beteiligunge		Instituts- nummer:		Prüf- ziffer:		Überge Unter	eordnetes nehmen:		Instituts Finanz	gruppe/ holding- Gruppe:			Stand Ende:	ı
Riskicogewichteter IRBA-Positionswert nach § 84 SolvV Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verfustquote bei Ausfall (%) IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berückschitigung von Kreditisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berückschitigung von Kreditisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten IRBA-Bemessungsgrundlage of Gesammsumme der Abgänge Gesammsumme der Abgänge (;) Gesammsumme der Abgänge (;) Gesamsumme der Abgänge (;) Gesamsung von Kreditisikominderungstechniken mit Rige Garantien und Kreditielrovate: International Kreditielrovate: International Kreditisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Solvinge Garantien und Kreditielrovate: International Kreditisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Solvinge Garantien und Kreditisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Solvinge Garantien und Kreditisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Solvinge Garantien und Kreditisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Solvinge Garantien und Kreditisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Solvinge Garantien und Kreditisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Solvinge Vor Solvinge Garantien und Kreditisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Solvinge Garantien und Kreditisikominderungstechniken (§ 100 SolvV) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung vor Berücksichtigun	Riskogewichteter IRBA-Positionswert nach § 84 SolvV Positionswertgewichtete durchschnittliche prognostizierte Verlustiquote bei Ausfall (%) IRBA-Positionswert nach § 99 SolvV Gesamtsumme der Zugänge won Kreditrisikoninderungstechniken mit Substitutionselfekten wird gesamtische nurd Krediteriabet nurd Kreditrisikongestenten und Kreditrisikong			ľ		ı										≅	IN MIO EURO
iditonswertgewichtete durchschnittliche nostzierie Verfustquote bei Ausfall (%) Committee Committ	iditonswertgewichtete durchschnittliche nostzierie Verfustquote bei Ausfall (%) Committee of the properties of the pr				Kreditrisik mit Substi IRBA-Be	cominder itutionsef messun	ungstecl fekten b gsgrundl	hniken bei den lagen			IF			Risikogew		Nachri Ang	Nachrichtliche Angaben
Gesamtsumme der Angsänder (b) Gesamtsumme der Zugänge (c) Gesamtsumme der Zugänge (c) Gesamtsumme der Abgänge (c) Gesamtsumme der Abgänge (c) Gesamtsumme der Zugänge (c)	In the control of the				und Kreditderivate: Inkongruenzen-	berücksichtigungs-	Substitu	utions-	Kreditrisikominderun		RBA-Positionswert na			ichteter IRBA-Position	Eigenkapitalanford	Erwartete Verlustber	(-) Wertberichtigung
Casamtheumet	Cesamtsumme		Einer Ratingstufe zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr-		Garantien	Kreditderivate			gstechniken mit	Außerbilanzielle Adressenausfall-	ch § 99 SolvV	Außerbilanzielle Adressenaus-		nswert nach § 84 SolvV	derungen	räge nach § 104 SolvV	en und Rückstellungen
Gesamtheir der IRBA- Beteiligungspositionen, die zu einem ausfalt- einem ausfalt- einem ausfalt- einem ausfalt- wahrscheinlichkeitsgesteuerhen Wahrscheinlichkeitsgesteuerhen (g/R Abs. z Nr. 1a Sokv/) Aufgliederung dieser IRBA-Beteiligungspositionen nach Patingstufen Aufglieder	Gesamtsumme 1. Gasamtheir der IRBA- Eiterligungspositionen, die zu einem ausfall- leinem ausfa		10	02	03	04	90		07=02+ 05 +06	80	60	10	Ξ	12	13	4	15
		10 Gesamtsumme													Übertrag ÜB Meldebogen		
			ren														
Patingstufe(a)	Patingstufe(a)	Aufgliederung dieser IRBA-Beteil	ligungspositionen n	ach Ra	tingstufen	١											
		Ratingstufe(a)															
			N 60	Ī													
			4														
			D 0														
			۷ ۲	I													
			8														
			6 9														ı
			2 =	Ī													
			2														
			E :														
			4 r														
			9	Ī													
			8 0														
			D 0	I													ı

5	57. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts-bzw. Finanzholding-Gruppe)	n (Instituts-bzw.	Finanzho	-dinbl	Gruppe	•					Ļ			≝ ¯	IRBA QB
Ψ.	IRBA-Forderungsklasse:	Beteiligungen	Instituts- nummer:		Prüf- ziffer:		Überged	Übergeordnetes Unternehmen:		Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe:	gruppe/ nolding- Gruppe:			Stand Ende:	
1		•	,											in Mio	Euro
		Kreditr	Kreditris mit Subs IRBA-B	kominde titutions emessu	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten bei den IRBA-Bemessungsgrundlagen	hniken bei den lagen			IF			Risikogewi		Nachrichtliche Angaben	chtliche
		essungsgrundlage vo isikominderungstechr es Ratingsystem	und Kreditderivate: Inkongruenzen- bereinigte Beträge	Als Gewährleistung berücksichtigungs- fähige Garantien	Substitutions- effekte	utions- kte	nessungsgrundlage n Kreditrisikominderun Substitutionsefi		RBA-Positionswert na		itionswertgewichtete o	chteter IRBA-Position	Eigenkapitalanford	Erwartete Verlustbet	(-) Wertberichtigung
		r Berücksichtigung von iken (§ 100 SolvV) Einer Ratingstufe zugeordnete prognostizierte Ausfallwahr- scheinlichkeit (%)	Garantien	Kreditderivate	(-) Gesamtsumme der Abgänge	Gesamtsumme der Zugänge	ach Berücksichtigung gstechniken mit	darunter: Außerbilanzielle Adressenausfall- risikopositionen	ch § 99 SolvV	darunter: Außerbilanzielle Adressenaus- fallrisikopositionen		nswert nach § 84 SolvV	derungen	räge nach § 104 SolvV	en und Rückstellungen
		01 02	03	04	90	90	07=02+ 05 +06	80	60	10	÷	12	13	14	15
5							201			I					
1 % % 6	250 23														
N 8 6															
, W F															
, % c															
ર છે છે															
ĭ ŏ															
₩ ₩															
₩ 4															
4 5															
ř															
4	2. Gesamtheit der IRBA- Beteiligungspositionen, die nach § 130 8 soluW mit dem altrachen Riskogewicht bewertet werden (§ 78 Abs. 2 Nr. 2 SolvV)														
	Aufgliederung dieser IRBA-Beteiligungspositionen	nach	Risikogewichten	chten											
4	Risikogewicht:														
4 4	450 370%														
74	3.Gesamtheit der IRBA- Beteiligungspostionen, die zu 470 einem modeligesteuerten IRBA- Beteiligungsportfolio gehören (5.78 Abs. 2 Nr. 1h SolvV)														
J	(a) Aufgliederung nach den prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeiten, die einer Ratingstufe jeweils zugeordnet sind, beginnend mit der Ratingstufe mit der niedrigsten prognostizierten Ausfallwahrscheinlichkeit. Blatt 2	erten Ausfallwahrschei	nlichkeiten	, die eine	er Ratings	stufe jewe	eils zugeor	dnet sind, b	eginnen	i mit der Rati	ngstufe	nit der ni	edrigsten pr	ognostizi Blatt 2	erten

IRBA QV 58. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe) IRBA-Forderungs-Übergeordnetes Verbriefungen Instituts-numme Prüfziffer Unternehmen: Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe Verbriefungsart: Summenblatt Stand Ende: in Mio Euro (-) Kreditrisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge Verbriefungs-positionen Synthetische Verbriefung: Auf das verbriefte Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechniken Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten auf die IRBA-Bemessungsgrundlage IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten Gesamtbetrag der Substitutionseffekte durch
Anwendung von
Kreditrisikominderungstechniken auf die IRBABemessungsgrundlage (-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsbereinigte Beträge (a) IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 SolvV) (-) Abgänge insgesamt Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche : Inkongruenzenbereinigte Beträge Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditdenvate: Nominalbetrag zurückbehaltener oder zurückerworbener Kreditbesicherung erzeugten Verbriefungspositionen Inkongruenzenbereinigte Beträge Um Währungsinkongruenzer bereinigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate **①** Zuflüsse Abgänge i insgesamt insgesamt 01 02 03 04 05 06 07 08 09 10 11 010 Gesamtsumme darunter: Wiederverbriefungs-011 Originator: Gesamtengagement Bilanzielle Adressenausfall-risikopositionen 031 Α 032 В 033 С D 035 Ε Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen 070 071 Α В 072 073 C 074 D Е Vorzeitige Tilgung (a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche Blatt 1

IRBA QV 58. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe) Übergeordnetes Unternehmen: IRBA-Forderungs-Prüfziffe Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe: Verbriefungsart: Summenblatt Stand Ende: Mio Euro (-) Kreditrisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeitbereinigte Beträge Verbriefungs-positionen Synthetische Verbriefung: Auf das verbriefte Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechniken Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten auf die IRBA-Bemessungsgrundlage IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositionen Substitutionseffekte durch Anwendung von Kreditrisikominderungs-techniken auf die IRBA-Bemessungsgrundlage IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 SolvV) (-) Abgänge insgesamt Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche : Inkongruenzenbereinigte Beträge ücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsbereinigte Beträge (a) Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditdenvate: Nominalbetrag zurückbehaltener oder zurückerworbener Kreditbesicherung Um Währungsinkongruenzen bereinigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderiv ate **:** Zuflüsse Abgänge insgesamt insgesamt 01 02 03 04 05 06 07 08 09 10 11 Investor: darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG 091 Bilanzielle Adressenausfall-risikopositionen 100 101 Α 102 В 103 C 104 D 105 Е Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen 141 Α 142 В С D 144 145 E Sponsor: Gesamtengagement Bilanzielle Adressen-ausfallrisikopositioner Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall-risikopositionen (a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche

				ber IRBA . Finanzh			e)													IRE	ва (QV			
	IRBA-Forderungs- klasse:		efungen	Instituts- nummer:		Prüf- ziffer:			ordnetes nehmen:																
	Verbriefungsart:	Sumn	nenblatt		tutsgrupp olding-G					Sta													in	Mio E	Eurc
		IRBA-Bemes	Bemess (12) Po	fgliederung ungsgrund von außer ositionen na Conversions	lage aus bilanziel ach IRBA	Spalte len \-					Aufg	gliede	erunç	g der	r IRB/	A-Po	ositio	onsw	erte	nach	n Ris	ikog			
		IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungstechniken	0%	>0% und <=20%	>20% und	>50% und <=100%	IRBA-Positionswert (§ 252 SolvV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 268 SolvV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugspositionen				(Во	nität	Rat	ingl	oasie bis 1	erter	Ansa i Lar	atz ngfris	strati	ng)			
		ksichtigung sämtlicher hniken	ő	<=20%	1 <=50%	<=100%	SolvV)	apital (§ 268 SolvV)	nswert nach zugspositionen	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	positionen Originator:																								
030	Bilanzielle																								
031	A																								
032	В											I													
033	C																								
034																									
070	Außerbilanzielle und			۰																					
071	А																								
072																									
074																									
075	E																								
080	Vorzeitige Tilgung																								

Blatt 3

IRBA QV

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

	(IIISIIIUIS- DZW	. FIIIalizi	iolullig	-Gi upp	e)			
IRBA-Forderungs- klasse:	Verbriefungen	Instituts- nummer:		Prüf- ziffer:		ordnetes mehmen:		
Verbriefungsart:	Summenblatt	Insti Finanzh	tutsgrupp olding-G				Stand Ende:	

Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (12) von außerbitanzeite in (12) von außerbitanzeite in (13) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (13) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (13) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (13) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (14) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (15) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (15) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (15) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (15) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (15) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (15) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (15) von außerbitanzeite und Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Riskogewic (15) von außerbitanzeite nach Riskogewic (16) von außerbitanzeite	lio Euro
12 13 14 15 16 17 18 19=17+ 20 21 22 23 24 42 43 44 25 45 46 26 47 27 Investor: Gesamtengagement darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offengungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist Bilanzielle Adressenaustall-risikopositionen 101 A	
12 13 14 15 16 17 18 19=17+ 20 21 22 23 24 42 43 44 25 45 46 26 47 27 Investor: Gesamtengagement darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offengungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist Bilanzielle Adressenaustall-risikopositionen 101 A	
Investor:	850% 750%
darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist Bilanzielle Adressenausfall-risikopositionen 101 A 102 B 103 C 104 D	48 49
Sponsor nicht of ferleigungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist Bilanzielle Adressenausfallnisikopositionen 101 A 102 B 103 C 104 D	
101 A 102 B 103 C 104 D 105 E	
102 B 103 C 104 D 105 E	
103 C 104 D 105 E	
104 D 105 E	
105 E	
Außerhilanzielle und	
140 Adressenausfall- risikopositionen	
141 A	
142 B	
143 C	
144 D	
145 E	
Sponsor: Gesamtengagement	-
Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen Außerbilanzielle und	
derivative Adressenausfall- risikopositionen	
	Blatt 4

IRBA QV

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

	IRBA-Forderungs-		Meldung ül briefungen	1	Instituts- nummer:	Sitioi	ieii (i	Prüf- ziffer:	5- DZW. F	manznoi		rdnetes Unti	ernehmen:]
	klasse: Verbriefungsart:	Sur	nmenblatt		Ir	stituts nzhold	grupp ing-Gr	e/					Stand Ende:		
		A	Aufgliederung		RBA-Posi ogewichte		verte n	ach	(-) Reduzierung des Wertbe	Risikogewich	Zuschlag zum risiko bei Verstoß gegen c	Zuschlagsbetrag auf zur Erfassung ei	Aggregierte Ka		in Mio Euro
			1250%	Bankaufsichtlicher Formel Ansatz		Durchschau	Internes Einstufungsverfahren		 (-) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen 	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 SolvV)	gewichteten IRBA-Posi die Sorgfaltspflichten na Bb Abs. 1 bis 3 und 5 K (§ 18b Abs. 6 KWG)	den risikogewichteten k ner Laufzeitunterdeckun Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung Kappungsregelungen	nachrichlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Aggregierte Kapitalanforderungen
		Mit Rating	Ohne Rating	Formel Ansatz	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	chau	ingsverfahren	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	-Positionswertes durch stellungen	rt (§ 253 SolvV)	Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 SolvV) bei Verstoß gegen die Sorgfaltspillichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)	Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten KSA/ IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbnefungen	e Anwendung der	ım Abgang von IRBA ngsklassen	ungen
		28	29	30	31	32	33	34	35	36	40	41	37	38	39
010	Gesamtsumme														Übertrag ÜB- Meldebogen
011	darunter: Wiederverbriefungs- positionen														Übertrag ÜB- Meldebogen
020	Originator: Gesamtengagement														
030	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen														
031	A														
032	В														
033	С														
034	D														
035	Е														
070	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen														
071	A														
072	В														
073															
074	E														
080	Vorzeitige Tilgung														
															Blatt 5

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

	klasse:	Ver	briefungen		Instituts- nummer:			Prut- ziffer:			Übergeo	rdnetes Unt	ernehmen:		
	Verbriefungsart:	Sui	mmenblatt				grupp ling-Gr						Stand Ende:		
		4	Aufgliederung		RBA-Posi ogewichte		verte n	ach	(-) Reduzierung des r Wertber	Risikogewichte	Zuschlag zum risikog bei Verstoß gegen dir 18	Zuschlagsbetrag auf d zur Erfassung eine	Aggregierte Kap		in Mio Euro Aggn
			1250%	Bankaufsichtlicher Formel Ansatz		Durchschau	Internes Einstufungsverfahren		 (-) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen 	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 SolvV)	ewichteten IRBA-Posit e Sorgfaltspflichten nad o Abs. 1 bis 3 und 5 KV (§ 18b Abs. 6 KWG)	len risikogewichteten K er Laufzeitunterdeckung Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Aggregierte Kapitalanforderungen
		Mit Rating	Ohne Rating	Formel Ansatz	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	nau	ıgsverfahren	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Positionswertes durch ellungen	(§ 253 SolvV)	Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 SolvV) 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/ IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen	Anwendung der	n Abgang von IRBA gsklassen	ingen
		28	29	30	31	32	33	34	35	36	40	41	37	38	39
0	Investor: Gesamtengagement														
0	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist														
1	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen														
1	01 A														
	02 B														
	03 C														
	05 E														
1	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen														
1	41 A														
1	42 B														
1	43 C														
1	44 D														
1	45 E														
1	Sponsor: Gesamtengagement														
	Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen														
															Blatt 6

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

in Mio Euro Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen 28 (-) Abzugsbetrag für Verbriefungspositionen 27 Vorzeitige Tilgungs-möglichkeit Angewandter Konversionsfaktor 56 Verbriefungspositionen (Bemessungsgrundlage vor Konversionsfaktoren) Kontrolliert? (ja/nein) 25 24 Außerbilanzielle Positionen und Derivate Sonstige Qualifizierte 23 Verbriefungs-Liquiditätsfazilität Direktes Kreditsubstitut 22 Erstverlust-position ohne Rating 21 20 Rating Bilanzpositionen Mezzanine ohne Rating 19 Rating 18 Stand Ende: löchstrangig 17 ohne Rating 16 Verbrief-ungs-struktur Erstverlustposition 15 Eigenkapitalanforderungen vor Verbriefung % Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe: (-) Wertberichtigungen und Rückstellungen 13 Verbriefte Positionen 12 ELGD % Ξ Anzahl der Positionen Verwendeter Ansatz (SA/IRB/MIX) 9 60 Art Über-geordnetes Unternehmen: 80 Anteil des Instituts (%) 07 Gesamtbetrag Gesamtbetrag der verbrieften Positionen zu Beginn der Verbriefung Verbriefungen ohne ABCP-Programme 90 Prüf-ziffer: Datum der Verbriefung (MM/JJJJ) 90 Stellung des Instituts: (SPONSOR / ORIGINATOR/ URSPRÜNGLICHER KREDITGEBER) 8 Selbstbehalt (§ 18a Abs. 1 KWG) Einhaltung der Anforderung an den Selbstbehalt %-Anteil des Selbstbehalts zum Meldestichtag 31 30 Art des Selbstbehalts 32 Verbriefung/ Wiederverbriefung Verbriefungsart (Synthetisch / Traditionell) 8 Instituts-nummer: Kennung der Verbriefung 05 0 Interner Code

59

Aggregierte Kapitalanforderungen

Q ABW

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

	ii	in Mio Euro	Eigenkapitalanforderung (§16 SolvV)	60		Übertrag ÜB-Meldebogen						Übertraq ÜB-Meldebogen)				
	Stand Ende:		Zugunsten des Institutes bestehender Unterschieds- betrag	02													
			Vereinbarter Abrechnungspreis	10													
Prüfziffer:	Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe		Geschäftstage nach vereinbartem Abrechnungstermin		Gesamtsumme	Gesamtsumme Anlagebuch	0 bis 4	5 bis 15	16 bis 30	31 bis 45	mehr als 45	Gesamtsumme Handelsbuch	0 bis 4	5 bis 15	16 bis 30	31 bis 45	mehr als 45
1.5	- % ::		Gesc														
Instituts- nummer	Überge- ordnetes Unter- nehmen:				010	011	020	030	040	020	090	020	080	060	100	110	120

61	I. Meldung zur	n o	pera	atior	nelle	n R	isiko	o (Ins	tituts- bz	w. Finanzho	olding-G	uppe)	QC	PR
	Institutsnummer:				Prüf	ziffer:				Übergeordnetes Unternehmen:				
99901	Angabe des Geschäftsjahres, auf das sich die Spalten 3 und 6		Fin	Instit nanzh		uppe/ g-Grup				Maßgebliches (Geschäftsjal palte 3 und (
	beziehen												in Mic	Euro
		(Brutt	Relevan Indikat toertraç 271 Sc	or g) nach	(nur bei ' eines Indik	lominal editvolu erford Verwer s altern ators) r 4 (3) So	men erlich ndung ativen nach §	Eigenkapitalanforc		(bei Ver	Nachrichtli wendung fortge	ch Angabene eschrittener Me	essansätze)	
	Geschäftsfelder	3. Jahr	2. Jahr	Vorjahr bzw. Vorvorjahr	3. Jahr	2. Jahr	Vorjahr bzw. Vorvorjahr	Elgenkapitalanforderungen (§§ 270, 273, 274 und 278 SolvV)	darunter: Aufgrund gruppeninterner Allokations mechanismen zugeordnete Eigen- kapitalanforderungen (§ 278 Abs. 4 SolvV) (b)	Eigenkapitalanforderungen vor Berücksichtigung von Reduktionseffekten aufgrund angemessener Berücksichtigung des erwarteten Verlustes in den internen Geschäftspraktiken und vor Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlagerung	(-) Reduzierung der Eigenkapitalanforderungen aufgrund der angemessenen Berücksichtigung der erwarteten Verluste in den internen Geschäftspraktiken (§ 284 Abs. 2 SolvV)	(-) Reduzierung der Eigenkapitalanforderungen aufgrund der Berücksichtigung von Instrumenten zur Ristkovertagerung (§ 292 SolvV)	darunter: Berücksichtigung von Versicherungen (§292 SolvV)	Höhe des Überschreitungsbetrages der in § 292 Abs. 1 Satz 2 SolvV festgelegten Höchstgrenze bei der Berücksichtigung von Instrumenten zur Risikoverlagerung
		01	02	03	04	05	06	S 07	08	09 = 07-10 -11	<u>ح</u> 10	7 ¥ 11	n 12	ο σ 13
010	1. Basisindikatoransatz							Übertrag ÜB- Meldebogen						
	(BIA)							j ÜB- ogen						
020	Gesamtheit der unter den Standardansatz (STA) / Alternativen Standardansatz (ASA) fallenden Geschäftstätigkeiten							Übertrag ÜB-Meldebogen						
	Zuordnung der Geschäftstätigkeiten im Standardansatz nach Geschäftsfeld:													
030	Unternehmens- finanzierung, -beratung													
040	Handel													
050	geschaft Firmenkunden-													
060	geschäft													
070	Zohlungovorkohr und													
	Abwicklung													
100	Treuhandgeschäft Vermögens-													
	zuordnung der Geschäftstätigkeiten im Alternativen Standardansatz nach Geschäftsfeld:													
110	Firmenkunden- geschäft													
120	•							_						
130	3. Fortgeschrittene Messansätze (AMA) (a)							Übertrag ÜB Meldeboger						

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

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

<u>≅</u>

	Instituts- numner:	Prüziffer:		Übergeordnetes Unternehmen:		Stand Ende:	in Mio Euro
		Potenzieller Risikobetrag	obetrag	Potenzieller Krisen-Risikobetrag	en-Risikobetrag	Zuschlagsbetrag für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsnisiko	usätzliche Ausfall- und srisiko
		Gewichtungsfaktor x Durchschnit der potenziellen Risikoberräge der letzten 60 Geschäftstage	Potenzieller Risikobetrag vom Vortag	Gewichtungstaktor x Durchschnitt der potenziellen Krisen- Risikobertäge der letzten 60 Geschäftstage	Zuletzt berechneter potenzieller Krisen- Risikobetrag	Zwölfwöchiger Durchschnitt der nach §§ 318a bis 318d SolvV ermittelten Beträge für das zusätzliche Austall- und Migrationsrisiko	Nach §§ 318a bis 318d Sokv Zuletz ermittelter Betrag für das zusätzliche Ausfall- und Migrationsrisiko
		0	05	80	60	10	÷
010	010 Positionen						
	Nachrichtlich: gegliedert nach Marktrisiko-kategorien						
020	020 1 Zinsnettoposition						
030	030 1.1 Allgemeines Kursrisiko						
040	040 1.2 Besonderes Kursnisiko						
050	050 2 Aktiennetto-position						
)90	060 2.1 Allgemeines Kursrisiko						
070	070 2.2 Besonderes Kursrisiko						
080	080 3 Währungsgesamt-position						
)60	090 4 Rohwarenposition						
100	5 Gesamtbetrag für das allgemeine Kursrisiko						
110	6 Gesamtbetrag für das besondere Kursrisiko						
							Blatt 1

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

į	in Mio Euro	Summe der Berücksichtigungs- beträge für passivisch aus gerichtete Zinsnettopositionen des Correlation Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 2 SolvV)	61													Blatt 2
		Summe der Berücksichtigungs- beräge für aktivisch ausgerichtete Zinsentigosalionen des Corration Trading Portfolios (§ 303 Abs. 5b Nr. 1 SolvV)	48													
	Nachrichtlich:	Gewichtungsfaktor Gewichtungsfaktor nach § 314 Abs. 1 Satz nach § 314 Abs. 1 Satz 1 Nr. 1 Buchstabe b 1 Nr. 2 Buchstabe b SolvV	17													
			91													
		Arzahl der Ausnahmen in den lerzten 250 Geschäftstagen	90													
Stand Ende:		Eigenmittel- anforderung	'05=Max [01,02] + Max [08,09] + Max [10,11] + Max [12,13,14] + 15	Übertrag ÜB-Meldebogen												
	olio	Zusätzliche Eigenkapitalanforderung für das Correlation Trading Portfolio (§ 314 Abs. 1a Satz 3)	5													
Übergeordnetes Unternehmen:	correlation Trading Portf	Nach § 318e SolvV zuletzt emittelter Betrag für das Correlation Trading Portfolio	41													
	Anrechnungsbeträge für das Correlation Trading Portfolio	Zwóltwöchiger Durchschnitt der nach § 318 eSolvV zuletz emittelten Beträge für das Correlation Trading Portfolio	13													
Prütziffer:	Anrec	Mindestanrechnungsbetrag für das Correlation Trading Portfolis (§ 314 Abs. 1a Satz 4 SolvV)	12 = 8% * Max [18, 19]													
Instituts- nummer:				010 Positionen	Nachrichtlich: gegliedert nach Marktrisiko-kategorien	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	5 Gesamtbetrag für das allgemeine Kursrisiko	6 Gesamtbetrag für das besondere Kursrisiko	
					202											

MKR QFW

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

Übergeordnetes Unternehmen:							Stand Ende:		
Institutsnummer: Prüfziffer: In	nstitu	Instituts-/Finanzholding-Gruppe:	aruppe:				Out:		
									- in Mio Euro -
Positionen		Insgesamt (Spalte 02 bis 07)	asn	GBP	용	YAC	CAD	Übrige Fremdwährungen	Gold
		01	02	03	04	05	90	20	90
Aktivpositionen 1.Bilanzielle Vermögensgegenstände einschl. zeitanteiliger Erträge	010								
2.Liefer- und Zahlungsansprüche aus Kassaqeschäften	020								
sonstige Derivate ohne Optionsrechte der Positionen 3 und 4	080								
Ansprüche auf Zahlung von Kapitalbeträgen aus Finanz-Swaps	040								
3.Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zustehende Liefer- oder Zahlungsansprüche aus Devisen- oder Goldoptionen	090								
4.Sonstige eigene Optionsrechte	090								
5.Sonstige Aktivpositionen	020								
Aktivpositionen insgesamt	100								
Passivpositionen 1.Bilanzielle Schulden einschließlich zeitanteiliger 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 Zahlungsverpfl. aus Devisen- oder Goldoptionen	150								
4. Sonstige fremde Optionsrechte	160								
5. Sonstige Passivpositionen	170								
Passivpositionen insgesamt	200								
Offene	210	+	+	+	+	+	+	+	+
Einzelwährungsposition	220	.7.	/*	77	Α.	77	77	.4.	1.
Nettowährungsposition (der größere Betrag - ohne Vorzeichen - der Zeilen 210/01 oder 220/01)	230						•	Offene Goldposition	
abzüglich 50 % der ausgeglichenen Währungsposition in eng verbundenen Währungen	240	A.							
zuzüglich offene Goldposition (Betrag der Zeile 230/08)	250	+							
zuzüglich des Anrechnungsbetrages für Investmentanteile nach § 294 Abs. 6 Satz 6 SolvV	255	+							
Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV	260	+				Nach	Nachrichtlich:		
Nettoabgrenzungsbetrag für zeitant. Erträge/Aufwendungen (nur für Institute, bei denen die Abgrenzurg nicht pro Fremdwährung verfügbar ist)	270	+				Struk 4 Abs	Strukturelle Währungspositionen nach § 4 Abs. 4 SolvV	nach § 99002	
Währungsgesamtposition (Summe der Zeilen 230 bis 270)	280		% 0'8 x	99001		Abzu 4 Abs	Abzugsposten in Fremdwährung nach § 4 Abs. 4 SolvV	nach § 99003	
				Anrechnungsbetra	Anrechnungsbetrag für Währungsgesamtposition	ntposition			

64. Marktrisikomeldung Rohwarenposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

MKR QRW

Übergeordnetes Unternehmen:	tuts-/				•		Stand	
Institutsnummer: Prüfziffer Fina		ing-Gru	ippe:				Ort:	
								- in Mio Euro -
Positionen			Insgesamt	Öle, Petroleum und Gas		wirtschaftl. eugnisse	Metalle	Übrige Rohwaren
			01	02		03	04	05
Aktivpositionen 1. Unter Aktiva der Bilanz auszuweisende Rohwarenbestände	010							
Lieferansprüche aus Kassageschäften	020							
Termingeschäften	030							
Swapgeschäften	040							
Als Optionsberechtigtem/Stillhalter zustehende Lieferansprüche	050							
Eventualansprüche auf Rückgabe von in Pension gegebenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	060							
Aktivpositionen insgesamt	100							
Passivpositionen 1. Lieferverpflichtungen aus Kassageschäften	110							
Termingeschäften	120							
Swapgeschäften	130							
Als Optionsberechtigter/Stillhalter zu erfüllende Lieferverpflichtungen	140							
Eventualverbindlichkeiten auf Rückgabe von in Pension genommenen Gegenständen der Aktivposition Nr. 1	150							
Passivpositionen insgesamt	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				Summe A		
II. Zeitfächermethode								
				01		02)3
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen r § 297 Abs. 2 Satz 3 SolvV		300				X 0%		
Summe der ausgeglichenen Bereichspositionen v und nach der Verrechnung zwischen den Zeitfäch		310				x 3,0 %		
Summe der offenen Bereichspositionen nach Verrechnung		320				x 0,6 %		
Verbleibende offene Bereichsposition		330				x 15,0 %		
		340				Summe B		
		350		Anrechnungsbeträge n				
		360		Anrechnungsbetrag fü		arenposition 30+340+350)		

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

Übergeordnetes Unternehmen:	mehmen:							Stand Ende:		Blatt 1
Institutsnummer:	Prü	Prüfziffer:		Instituts-/Finanzholding-Gruppe:	::			Ort:	t:	
Allgemeines Kursı	Kursrisiko Zinsnettoposition	ettop	osition							- in Mio Euro -
			Insgesamt		Kurzfristige	Kurzfristige Laufzeitzone		M	Mittelfristige Laufzeitzone	е
Nominalverzinsung < 3 % bzw. gemäß Duration	sung < 3 % Duration		(Summe aus Spalten 02 bis 16)	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 %	% € < Buns			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	90	90	20	80
I. Jahresbandmethode Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	110								
Insgesamt	passivische Ausrichtung	120								
	aktivische Ausrichtung	130								
in Euro	passivische Ausrichtung	140								
	aktivische Ausrichtung	150								
	passivische Ausrichtung	160								
II. Durationmethode: Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	170								
	passivische Ausrichtung	180								
gewichtete Zinsnettoposition	aktivische Ausrichtung	190								
Insgesamt	passivische Ausrichtung	200								
	aktivische Ausrichtung	210								
Zinsnettoposition in Euro	passivische Ausrichtung	220								
	aktivische Ausrichtung	230								
Zinsnettoposition in US-\$	passivische Ausrichtung	240								
Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV	ch § 3 Abs. 3	250								
Teilanrechnungsbetrag für das allgemeine Kursrisiko	risiko	300								

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

Übergeordnetes Unternehmen:	mehmen:							Stand Ende:	le:	Blatt 2
Institutsnummer:	Prüf	Prüfziffer:	Instituts-/Finar	Instituts-/Finanzholding-Gruppe:				Ō	Ort:	
Allgemeines Kursrisiko Zinsnettoposition	risiko Zinsn	ettopo	sition							- in Mio Euro -
						Langfristige	Langfristige Laufzeitzone			
Nominalverzinsung < 3 % bzw. gemäß Duration	nsung < 3 % 3 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 %	% € ≤ Bunsı		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		
			60	10	11	12	13	14	15	16
I. Jahresbandmethode Zinsnettoposition	Aktivische Ausrichtung	110								
Insgesamt	Passivische Ausrichtung	120								
darunter:	Aktivische Ausrichtung	130								
in Euro	Passivische Ausrichtung	140								
darunter:	Aktivische Ausrichtung	150								
in US-\$	Passivische Ausrichtung	160								
II. Durationsmethode: Zinsnettoposition	Aktivische Ausrichtung	170								
Insgesamt	Passivische Ausrichtung	180								
gewichtete Zinsnettoposition	Aktivische Ausrichtung	190								
Insgesamt	Passivische Ausrichtung	200								
darunter: gewichtete	Aktivische Ausrichtung	210								
Zinsnettoposition in Euro	Passivische Ausrichtung	220								
darunter: gewichtete	Aktivische Ausrichtung	230								
Zinsnettoposition in US-\$	Passivische Ausrichtung	240								

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

MKR QZK

Übergeordnetes Unternehmen:					Stand Ende:	Blatt 3
Institutsnummer: Prüfz	Prüfziffer:	Instituts-/Finanzholding-Gruppe:	Gruppe:		Ort:	
Besonderes Kursrisiko Zinsnettoposition	topo	sition				- in Mio Euro -
Positionen		Zinsnettoposition	Gewichtungssätze	risikogewichtete Zinsnettoposition	Gewichtung nach § 303 Abs. 1	Anrechnungsbeträge
		01	02	03	04	02
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 2 und Abs. 2a	310		% 0'0 ×			
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 3 Restlaufzeit bis 6 Monate	320		x 3,125 %			
Restlaufzeit über 6 Monate bis zu 2 Jahren	330		x 12,5 %			
Restlaufzeit von mehr als 2 Jahren	340		× 20,0 %			
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 1	350		× 100,0 %		% 8 X	
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 4	360		× 150,0 %			
Nettopositionen i.S. von § 303 Abs. 6	380					
Summe Zinsnettopositionen	400	ï			Summe	
		410		Anrechnun	Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV	
		420		Teilanrechnungsbetr	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	03
Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 1	200	X 32%	
Investmentanteile nach § 307 Abs. 1 Satz 2 510	510	X 40 %	
Summe	520		

MKR QAK

Stand Ende: Ort:

66. Marktrisikomeldung Aktiennettoposition (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

Name:

Prüfziffer:

Institutsnummer:

Nationaler		Aktiennettoeinzelpositionen	zelpositionen	Aktiennettoposition	Anrechnungsbeträge für das allgemeine Kursrisiko	Aktienbruttoposition	n Anrechnungsbeträge für das besondere Kursrisiko
Markt des Emittenten	_	aktivische Ausrichtung	passivische Ausrichtung	(saldierte Nettoposition)	Spalte 03 x 8,0 %		Spalte 08 x 8,0%
		01	02	03	04	80	60
Deutschland	010						
Frankreich	020						
Großbritannien	030						
Japan	040						
USA	020						
übrige Länder	090						
	070	Teilanr	Teilanrechnungsbetrag für das allgemeine Kursrisiko (Summeder Spalte 04)	Ilgemeine Kursrisiko (Summe der Spatte 04)		Summe	эс
	080			Teilanrechr	Teilanrechnungsbetrag für das besondere Kursrisiko (Summe der Spatte 09)	ndere Kursrisiko (Summe der Spalte 09)	
	060		Anrec	hnungsbeträge nach § 3 A	Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV für das allgemeine Kursrisiko	ine Kursrisiko C	
	100		Anrec	hnungsbeträge nach § 3 /	Anrechnungsbeträge nach § 3 Abs. 3 SolvV für das besondere Kursrisiko	lere Kursrisiko D	
	110			¥	Anrechnungsbetrag für Aktiennettoposition	nnettoposition (A+B+C+D)	

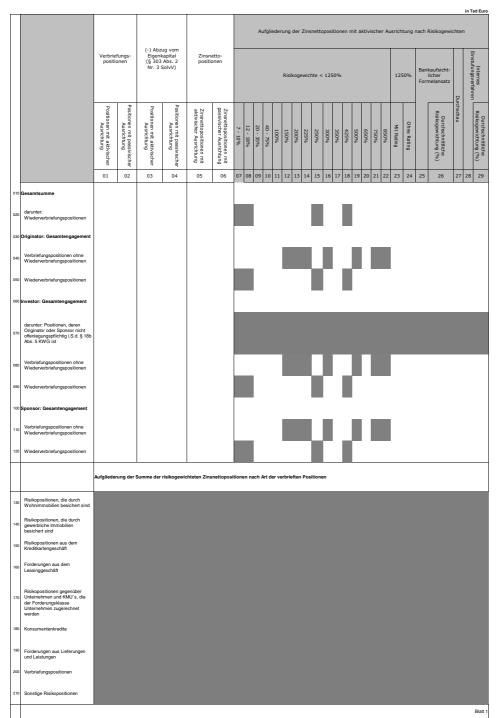
67. Zusatzinformationen zu den gruppenangehörigen Unternehmen: Gruppensolvabilitätsbeitrag

Q ZU

	in Mio Euro	en Eigenmitteln	darunter: Kernkapital	07	
Institutsgruppe/ Finanzholding- Gruppe		Beitrag zu de		90	
		en		03 = 04 + 05	
Übergeordnetes Unternehmen:	•	enkapitalanforderung	Marktrisiko	90	
		in den bankaufsichtlichen Konsolidierungskreis einbezogene Unternehmen* in den bankaufsichtlichen Konsolidierungskreis einbezogene Unternehmen*	siken	1	
Prüfziffer:		Beitr	Adressrisiken	04	
		aufsichtlichen erungskreis Unternehmen*	соре	05	
Instituts- nummer:	Stand Ende:	in den bank Konsolidi einbezogene	NAME	01	

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

68. Mark	trisikomeldungen Verbri	efungspo	ositionen		MKR EV
Instituts- nummer:		Prüfziffer:		Name:	
Ort:				Stand Ende:	



68. Marktrisikom	eldungen Verbriefu	ıngsposi	tionen		MKR EV
Institutsnummer:		Prüfziffer:		Name:	
Ort:				Stand Ende:	

		in	Tsd Euro
		Aufgliederung der Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung nach Risikogewichten Zuschlag zu den	
		Risikogewichtete Zinsnettopositionen bei Verstöß gegen die Zinsnettopositionen vor Andwenung der Kappungsregel Anwendung der Kappungsregel Anwendung der Kappungsregel Sin in Sorgfaltsgificheten nach § 18a Abs. 4 nd § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 kWG)	Aggregierte Kapitalanforderungen
		Summe der fielscapskicheten Zussettapskicheten mit passkicheten Ausrichtung Summe des Zussettapskicheten fielkogswichteten zinsettapsskicheten mit passkicheten Ausrichtung Zussehlag zu den räklogswichteten fürsettapsskicheten wird zussettapskicheten zussettapsskicheten mit zussettapskicheten zu zussettapskicheten zu	nforderungen
			61
01	© Gesamtsumme	Überti Meldi	rag ÜB- ebogen
02	darunter: Wiederverbriefungspositionen		
03	Originator: Gesamtengagement		
04	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen		
05	Wiederverbriefungspositionen		
Of	0 Investor: Gesamtengagement		
07	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist		
OE	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen		
09	Wiederverbriefungspositionen		
10	Sponsor: Gesamtengagement		
11	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen		
12	Wiederverbriefungspositionen		
		ufgliederung der Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen nach Art der verbrieften Positionen	
13	Risikopositionen, die durch Wohnimmobilien besichert sind		
14	Risikopositionen, die durch gewerbliche Immobilien besichert sind		
15	Distance Management and		
16	Forderungen aus dem Leasinggeschäft		
17	Risikopositionen gegenüber Unternehmen und KMU's, die der Forderungsklasse Unternehmen zugerechnet werden		
18	0 Konsumentenkredite		
19	Forderungen aus Lieferungen und Leistungen		
20	Verbriefungspositionen		
21	Sonstige Risikopositionen		
			Blatt 2

60	Marktrisikomeldungen	Correlation	Tradina	Portfolio
os.	Marktrisikomeidungen	Correlation	irading	POILIOIIO

MKR ECTP

Institutsnummer:	Prüfziffer:	Name:	
Ort:		Stand Ende:	

																							in ¹	rsd Euro
								Auf	fglie	ederu	ing d	ler N	lettop	ositi	onen	mit	akti	visch	ner Au	ısrichtung	nach	Risi	kogewi	chten
		Correl Trading F Positi	ortfolio-	Eigenl (§ 303	ug vom capital Abs. 2 SolvV)	Zinsnetto	positionen		Ri	isiko	gewi	chte	< 12	:50%	,		1250)%		kaufsicht- licher nelansatz	Durch		Internes	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%	250%	350%	425%	CTOCK COUNTY	Mit Rating	Ohne Rating		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschau		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	kogewichte
		01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11	12	13 1	4 1	5 1	16	17	18	19	20	21	22	23
	Gesamtsumme 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	П				1		ı																
110	Nth-to-default-Kreditderivate																							
120	Sonstige Correlation Trading Portfolio- Positionen																							
																								Blatt 1

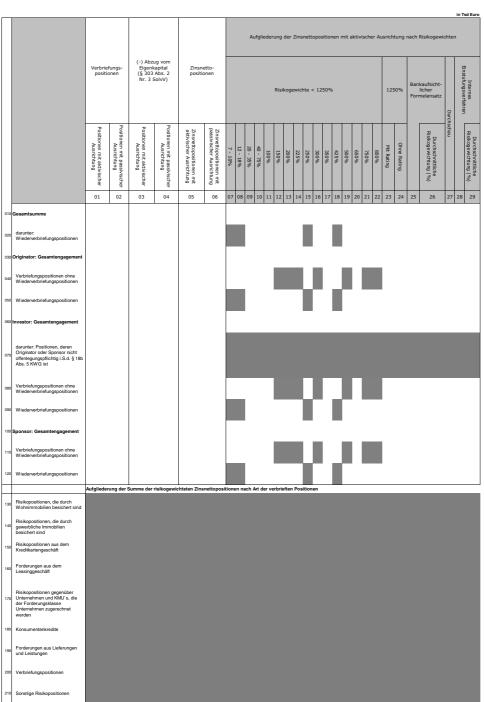
60	Marktrisikome	ldunaan	Correlation	Tradina	Dortfolio
os.	warktrisikome	ıaungen	Correlation	irading	PORLIGIIO

MKR ECTP

Institutsnumm	er:	Prüfziffer:	Name:	
Ort:			Stand Ende:	

																				_	ı				in Tsd Euro
				Auf	fglied	deru	ung	der	· Net	topo	sitio Risi	onen ikoge	mit p wich	assivi ten	scher Aus	srich	itun	ıg n	ach						
			Risikogewichte < 1250%									125	60%		kaufsicht- licher nelansatz	:	,	Einstufungsverfahren	Internes	Andere Ris	Zinsnettopo Anweno Kappung § 303 Ab	ewichtete ositionen vor dung der gsregel in s. 1 Satz 3 dvV	Zinsnettop Anwer Kappur	ewichtete ositionen nach idung der igsregel in 1 Satz 3 SolvV	Aggregierte Kapitalanforderungen
		7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100.00	100%	250%	350%	425%	650%	Mit Rating	Ohne Rating		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschau			Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Andere Risikogewichte	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung	derungen
		24	25	26	5 27	7 2	28	29	30	31	32	33	34	35	36	3	7 3	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 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

70. Marktrisiko	meldungen Verbri	efungspositionen		MKR QV
Institutsnummer:		Prüfziffer:	Name:	
Ort:			Stand Ende:	



70. Marktrisikome	eldungen Verbrie	fungspositionen	MKR QV		
Institutsnummer:		Prūfziffe r:		Name:	
Ort:				Stand Ende:	

																														in Tsd E
			Aut	fgliede	erung (der Zi	nsnel	topos	sitione	en mi	t pas	siviscl	her A	lusric	htung	g nach	ı Risik	ogewi	chtei	n		Zuschlag	3 zu den							
					Ris	ikoge	wicht	e < 1	250%	ó				12	50%		kaufs licher melar	r nsatz	Durch	Internes Einstufungsverfahren		risikogew	vichteten nen bei Verstoß gfaltspflichten s. 4 und § 18b und 5 KWG	Zinsn Anwendu	sikogewicht ettopositior ng der Kap in Abs. 1 Satz	nen vor pungsregel	Zinsne Anwendui	ikogewicht ttoposition ng der Kap in Abs. 1 Satz	en nach pungsregel	Aggregierte Kapitalanforderungen
		7 - 10%	20 - 35%	40 - 75%	100%	200%	225%	250%	350%	425%	500%	750%	850%	Mit Rating	Ohne Rating		Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche	Durchschau	Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche	Zuschlag zu den risikogewichteten Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	Zuschlag zu den risikogewichteten Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit aktivischer Ausrichtung	risikogewichtete Zinsnettopositionen mit passivischer Ausrichtung	Summe der risikogewichteten Zinsnettopositionen	lerungen
		30 3	1 32	33	34 3	36	37	38 3	9 40	41	42 4	13 44	45	46	47	48	4	49	50	51 52	2	53	54	55	56	57	58	59	60	61
010	Gesamtsumme																													Übertrag Ü Meldeboge
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		Ξ					J		J					Ī						I									
090	Wiederverbriefungspositionen																													
100	Sponsor: Gesamtengagement																													
110	Verbriefungspositionen ohne Wiederverbriefungspositionen									J																				
120	Wiederverbriefungspositionen																													
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 Forderungsklasse Unternehmen zugerechnet werden																													
180	Konsumentenkredite Forderungen aus Lieferungen																													
190	und Leistungen																													
200	Verbriefungspositionen																													
210	Sonstige Risikopositionen																													В

71	Marktrisikomeldunge	Correlation	Trading	Portfolio
<i>/</i> 1.	warkii isikoilleluuliye	i Correlation	Haulily	PULLIUIIU

MKR QCTP

nstitutsnummer:	Prüfziffer:	Name:	
Ort:		Stand Ende:	

										A.,6a	امما			aw Ne	thon	ooit	ionos		a letin	iaahau Aus	ui ala	tu un a		sd Euro			
				() Ab-						Aurg	lied	erun	g ae	er Ne	ettop	Ris	ikoge	n mit	nten	ischer Aus	srich	tung	nacn				
		Corre Trading Positi	Portfolio-	Eigenl (§ 303	ug vom kapital Abs. 2 SolvV)	Zinsnetto	positionen		R	isiko	gew	richte	e <	1250)%		125	50%		kaufsicht- licher nelansatz	Durchschau	Ellstalaligsvellalileli	Andere Risikogewichte Internes Internes Risikogew				
		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%	250%	350%	425%	650%	Mit Rating	Ohne Rating		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	schau		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	kogewichte			
		01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23			
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																										
1																								Blatt			

71	Marktrisikomeldungen	Correlation	Dortfolio

MKR QCTP

Institutsnummer:	Prüfziffer:	Name:	
Ort:		Stand Ende:	

																					I		in Tsd Euro
			Д	Aufgli	iede	rung	g dei	r Net	ttop		onen ikoge			ischer Au	ısric	htun	g nac	h	Disiliana		Distilu		
			R	Risiko	ogev	vicht	e <	125	0%		125	50%	- 1	kaufsicht- icher nelansatz		Einstulungsvenanren	Internes	Andere Ris	Zinsnettopo Anwend Kappung § 303 Abs	wichtete sitionen vor lung der Isregel in s. 1 Satz 3 IVV	Zinsnettopo Anwen Kappun § 303 Ab	ewichtete ssitionen nach dung der gsregel in ss. 1 Satz 3 olvV	Aggregierte Kapitalanforderungen
		Tisikogewichtete Zinsnettopositionen mit Passivischer Ausrichtung Tisikogewichtete Zinsnettopositionen mit Aktivischer Ausrichtung Andere Risikogewichtete Zinsnettopositionen mit Aktivischer Ausrichtung Andere Risikogewichtete Zinsnettopositionen mit Aktivischer Ausrichtung Andere Risikogewichtete Zinsnettopositionen mit Aktivischer Ausrichtung A														rderungen							
		24	2	5 26	27	7 28	29	30	31	32	33	34	35	36	37	38	39	40	41	42	43	44	45
010	Gesamtsumme			•		•	•	•		•					•	•						ı	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	1																					
110	Nth-to-default-Kreditderivate																						
120	Sonstige Correlation Trading Portfolio-Positionen																						5
Ц	I .	1																					Baltt 2