

**Finanzinformationen gemäß § 25 Absatz 1 Satz 1 KWG  
– Sonstige Angaben –**

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

Die angegebenen Beträge lauten auf volle Euro.<sup>1</sup>

**Sonstige Angaben**

**(1) Angaben zu stillen Reserven und stillen Lasten**

**010 Stille Reserven**

020	bei Finanzinstrumenten ( <u>nicht</u> Bestandteil einer Bewertungseinheit)		
030	in Wertpapieren außerhalb des Handelsbestands		
040	bei Schuldverschreibungen und anderen festverzinslichen Wertpapieren	040	_____
	<u>darunter:</u> 050 kurzfristig realisierbar	050	_____
060	bei Aktien und anderen nicht festverzinslichen Wertpapieren	060	_____
	<u>darunter:</u> 070 kurzfristig realisierbar	070	_____
	<u>darunter:</u> 080 in offenen Spezial-AIF <sup>2</sup>	080	_____
		(040 + 060) 030	_____
090	in Derivaten	090	_____
		(030 + 090) 020	_____
100	bei Finanzinstrumenten (Bestandteil einer Bewertungseinheit) <sup>3</sup>		
110	in Wertpapieren außerhalb des Handelsbestands		
120	bei Schuldverschreibungen und anderen festverzinslichen Wertpapieren	120	_____
130	bei Aktien und anderen nicht festverzinslichen Wertpapieren	130	_____
		(120 + 130) 110	_____
140	in Derivaten	140	_____
		(110 + 140) 100	_____
		(020 + 100) <b>010</b>	_____

**150 Stille Lasten**

160	bei Finanzinstrumenten ( <u>nicht</u> Bestandteil einer Bewertungseinheit)		
170	in Wertpapieren außerhalb des Handelsbestands		
180	bei Schuldverschreibungen und anderen festverzinslichen Wertpapieren	180	_____
190	bei Aktien und anderen nicht festverzinslichen Wertpapieren	190	_____
	<u>darunter:</u> 200 in offenen Spazial-AIF <sup>2</sup>	200	_____
		(180 + 190) 170	_____
210	in Derivaten	210	_____
		(170 + 210) 160	_____
220	bei Finanzinstrumenten (Bestandteil einer Bewertungseinheit) <sup>3</sup>		
230	in Wertpapieren außerhalb des Handelsbestands		
240	bei Schuldverschreibungen und anderen festverzinslichen Wertpapieren	240	_____
250	bei Aktien und anderen nicht festverzinslichen Wertpapieren	250	_____
		(240 + 250) 230	_____
260	in Derivaten	260	_____
		(230 + 260) 220	_____
		(160 + 220) <b>150</b>	_____

**(2) Angaben zum Kreditgeschäft**

<b>270</b>	<b>Höhe des Kreditvolumens</b>	<b>270</b>	_____
	<u>darunter:</u> 280 Kredite an Nichtbanken	280	_____
<b>290</b>	<b>Kredite mit erhöhter Ausfallwahrscheinlichkeit (Gelbbereich)</b>	<b>290</b>	_____

<b>300</b>	<b>In Verzug geratene Kredite (ohne Kredite, für die eine Einzelwertberichtigung gebildet wurde)</b>	<b>300</b>	_____
310	hierfür bestehende Sicherheiten	310	_____
<b>320</b>	<b>Einzelwertberichtigte Kredite vor Absetzung von Einzelwertberichtigungen</b>	<b>320</b>	_____
330	hierfür bestehende Sicherheiten	330	_____
340	Höhe der individuellen Einzelwertberichtigungen	340	_____
<b>350</b>	<b>Höhe der pauschalierten Einzelwertberichtigungen</b>	<b>350</b>	_____
<b>360</b>	<b>Unversteuerte Pauschalwertberichtigungen</b>	<b>360</b>	_____
<b>370</b>	<b>Abschreibungen auf Forderungen zu Lasten der Gewinn- und Verlustrechnung</b>	<b>370</b>	_____
<b>(3) Angaben zu Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch<sup>4</sup></b>			
<b>379</b>	<b>Anwendung des § 2a Absatz 1 KWG (= 1)</b>	<b>379</b>	_____
<b>380</b>	<b>Zinsbuchbarwert</b>	<b>380</b>	_____
<b>390</b>	<b>Barwertänderung bei Zinserhöhung<sup>5</sup> – Standardtest</b>	<b>390</b>	_____
<b>400</b>	<b>Zinskoeffizient bei Zinserhöhung<sup>5</sup> (in %) – Standardtest</b>	<b>400</b>	_____
<b>410</b>	<b>Barwertänderung bei Zinssenkung<sup>5</sup> – Standardtest</b>	<b>410</b>	_____
<b>420</b>	<b>Zinskoeffizient bei Zinssenkung<sup>5</sup> (in %) – Standardtest</b>	<b>420</b>	_____
<b>421</b>	<b>Barwertänderung bei paralleler Zinserhöhung<sup>5</sup> – Frühwarnindikator (FWI)</b>	<b>421</b>	_____
<b>422</b>	<b>Zinskoeffizient bei paralleler Zinserhöhung<sup>5</sup> (in %) – FWI</b>	<b>422</b>	_____
<b>423</b>	<b>Barwertänderung bei paralleler Zinssenkung<sup>5</sup> – FWI</b>	<b>423</b>	_____
<b>424</b>	<b>Zinskoeffizient bei paralleler Zinssenkung<sup>5</sup> (in %) – FWI</b>	<b>424</b>	_____
<b>425</b>	<b>Barwertänderung bei Versteilung der Zinskurve<sup>5</sup> – FWI</b>	<b>425</b>	_____
<b>426</b>	<b>Zinskoeffizient bei Versteilung der Zinskurve<sup>5</sup> (in %) – FWI</b>	<b>426</b>	_____
<b>427</b>	<b>Barwertänderung bei Verflachung der Zinskurve<sup>5</sup> – FWI</b>	<b>427</b>	_____
<b>428</b>	<b>Zinskoeffizient bei Verflachung der Zinskurve<sup>5</sup> (in %) – FWI</b>	<b>428</b>	_____
<b>429</b>	<b>Barwertänderung bei Kurzfristschock aufwärts<sup>5</sup> – FWI</b>	<b>429</b>	_____
<b>431</b>	<b>Zinskoeffizient bei Kurzfristschock aufwärts<sup>5</sup> (in %) – FWI</b>	<b>431</b>	_____
<b>432</b>	<b>Barwertänderung bei Kurzfristschock abwärts<sup>5</sup> – FWI</b>	<b>432</b>	_____
<b>433</b>	<b>Zinskoeffizient bei Kurzfristschock abwärts<sup>5</sup> (in %) – FWI</b>	<b>433</b>	_____
<b>435</b>	<b>Berücksichtigung (= 1) oder Nicht-Berücksichtigung (= 2) von Margen in Cashflows</b>	<b>435</b>	_____
<b>(4) Weitere Angaben</b>			
<b>440</b>	<b>Nettoergebnis aus der vorzeitigen Beendigung von Derivaten<sup>5, 6</sup></b>	<b>440</b>	_____
<b>450</b>	<b>Konditionenbeitrag<sup>5</sup></b>	<b>450</b>	_____
460	Aktivgeschäft <sup>5</sup>	460	_____
470	Passivgeschäft <sup>5</sup>	470	_____
<b>480</b>	<b>Strukturbeitrag<sup>5</sup></b>	<b>480</b>	_____

<sup>1</sup> Angaben – außer bei Posten 400, 420, 422, 424, 426, 428, 431 und 433 – bitte ohne Kommastellen, Rundung nach kaufmännischer Rundungsregel (5/4).

Die Angaben zu den Posten 400, 420, 422, 424, 426, 428, 431 und 433 sind mit zwei Kommastellen anzugeben.

<sup>2</sup> Darunter fallen alle offenen inländischen, EU- und ausländischen Spezial-AIF im Sinne des § 1 Absatz 6 bis 9 KAGB.

<sup>3</sup> Grundgeschäft und Sicherungsgeschäft sind separat auszuweisen.

<sup>4</sup> Gemäß aktuellem Rundschreiben zum Zinsänderungsrisiko der BaFin: Institute, die von der Anwendung des § 2a Absatz 1 KWG Gebrauch machen, sind von einer Meldung zu Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch im Rahmen dieses Meldeformulars befreit, sofern entsprechende Angaben bei der Meldung des übergeordneten Unternehmens auf zusammengefasster Basis (Meldeformular Sonstige Angaben – QSA) Berücksichtigung finden.

<sup>5</sup> Vorzeichen angeben.

<sup>6</sup> Aus Zinsbuchsteuerung und/oder Bewertungseinheiten.

<b>Größere Veränderungen einzelner Positionen bitte gesondert erläutern.</b>
--