

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

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

Die angegebenen Beträge lauten auf volle Euro.¹

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 ²	080	_____
		(040 + 060) 030	_____
090	in Derivaten	090	_____
		(030 + 090) 020	_____
100	bei Finanzinstrumenten (Bestandteil einer Bewertungseinheit) ³		
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) 010	_____

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 ²	200	_____
		(180 + 190) 170	_____
210	in Derivaten	210	_____
		(170 + 210) 160	_____
220	bei Finanzinstrumenten (Bestandteil einer Bewertungseinheit) ³		
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) 150	_____

(2) Angaben zum Kreditgeschäft

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

300	In Verzug geratene Kredite (ohne Kredite, für die eine Einzelwertberichtigung gebildet wurde)	300	_____
310	hierfür bestehende Sicherheiten	310	_____
320	Einzelwertberichtigte Kredite vor Absetzung von Einzelwertberichtigungen	320	_____
330	hierfür bestehende Sicherheiten	330	_____
340	Höhe der individuellen Einzelwertberichtigungen	340	_____
350	Höhe der pauschalierten Einzelwertberichtigungen	350	_____
360	Unversteuerte Pauschalwertberichtigungen	360	_____
370	Abschreibungen auf Forderungen zu Lasten der Gewinn- und Verlustrechnung	370	_____
(3) Angaben zu Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch⁴			
379	Anwendung des § 2a Absatz 1 KWG (= 1)	379	_____
380	Zinsbuchbarwert	380	_____
390	Barwertänderung bei Zinserhöhung⁵ – Standardtest	390	_____
400	Zinskoeffizient bei Zinserhöhung⁵ (in %) – Standardtest	400	_____
410	Barwertänderung bei Zinssenkung⁵ – Standardtest	410	_____
420	Zinskoeffizient bei Zinssenkung⁵ (in %) – Standardtest	420	_____
421	Barwertänderung bei paralleler Zinserhöhung⁵ – Frühwarnindikator (FWI)	421	_____
422	Zinskoeffizient bei paralleler Zinserhöhung⁵ (in %) – FWI	422	_____
423	Barwertänderung bei paralleler Zinssenkung⁵ – FWI	423	_____
424	Zinskoeffizient bei paralleler Zinssenkung⁵ (in %) – FWI	424	_____
425	Barwertänderung bei Versteilung der Zinskurve⁵ – FWI	425	_____
426	Zinskoeffizient bei Versteilung der Zinskurve⁵ (in %) – FWI	426	_____
427	Barwertänderung bei Verflachung der Zinskurve⁵ – FWI	427	_____
428	Zinskoeffizient bei Verflachung der Zinskurve⁵ (in %) – FWI	428	_____
429	Barwertänderung bei Kurzfristschock aufwärts⁵ – FWI	429	_____
431	Zinskoeffizient bei Kurzfristschock aufwärts⁵ (in %) – FWI	431	_____
432	Barwertänderung bei Kurzfristschock abwärts⁵ – FWI	432	_____
433	Zinskoeffizient bei Kurzfristschock abwärts⁵ (in %) – FWI	433	_____
435	Berücksichtigung (= 1) oder Nicht-Berücksichtigung (= 2) von Margen in Cashflows	435	_____
(4) Weitere Angaben			
440	Nettoergebnis aus der vorzeitigen Beendigung von Derivaten^{5, 6}	440	_____
450	Konditionenbeitrag⁵	450	_____
460	Aktivgeschäft ⁵	460	_____
470	Passivgeschäft ⁵	470	_____
480	Strukturbeitrag⁵	480	_____

¹ 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.

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

³ Grundgeschäft und Sicherungsgeschäft sind separat auszuweisen.

⁴ 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.

⁵ Vorzeichen angeben.

⁶ Aus Zinsbuchsteuerung und/oder Bewertungseinheiten.

Größere Veränderungen einzelner Positionen bitte gesondert erläutern.
--