

**Finanzinformationen gemäß § 25 Absatz 2 KWG
– Sonstige Angaben –**

(Übergeordnetes Unternehmen einschließlich nachgeordneter Unternehmen mit Sitz im Inland und im Ausland)¹

Übergeordnetes Unternehmen _____

Institutsgruppe/Finanzholding-Gruppe/gemischte Finanzholding-Gruppe (gemäß § 10a Absatz 1 Satz 2, 4 bis 8 und Absatz 2 in Verbindung mit Absatz 3 KWG) _____

Institutsnummer: _____

Prüfziffer: _____

Ort: _____

Stand Ende: _____

Die angegebenen Beträge lauten auf volle Euro.²

Sonstige Angaben

(1) Angaben zu Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch³

378	Steuerung der Zinsänderungsrisiken auf Anwendungsebene des Gruppen-Waivers (= 1)	378	_____
380	Zinsbuchbarwert	380	_____
390	Barwertänderung bei Zinserhöhung⁴ – Standardtest	390	_____
400	Zinskoeffizient bei Zinserhöhung⁴ (in %) – Standardtest	400	_____
410	Barwertänderung bei Zinssenkung⁴ – Standardtest	410	_____
420	Zinskoeffizient bei Zinssenkung⁴ (in %) – Standardtest	420	_____
421	Barwertänderung bei paralleler Zinserhöhung⁴ – Frühwarnindikator (FWI)	421	_____
422	Zinskoeffizient bei paralleler Zinserhöhung⁴ (in %) – FWI	422	_____
423	Barwertänderung bei paralleler Zinssenkung⁴ – FWI	423	_____
424	Zinskoeffizient bei paralleler Zinssenkung⁴ (in %) – FWI	424	_____
425	Barwertänderung bei Versteilung der Zinskurve⁴ – FWI	425	_____
426	Zinskoeffizient bei Versteilung der Zinskurve⁴ (in %) – FWI	426	_____
427	Barwertänderung bei Verflachung der Zinskurve⁴ – FWI	427	_____
428	Zinskoeffizient bei Verflachung der Zinskurve⁴ (in %) – FWI	428	_____
429	Barwertänderung bei Kurzfristschock aufwärts⁴ – FWI	429	_____
431	Zinskoeffizient bei Kurzfristschock aufwärts⁴ (in %) – FWI	431	_____
432	Barwertänderung bei Kurzfristschock abwärts⁴ – FWI	432	_____
433	Zinskoeffizient bei Kurzfristschock abwärts⁴ (in %) – FWI	433	_____
435	Berücksichtigung (= 1) oder Nicht-Berücksichtigung (= 2) von Margen in Cashflows	435	_____

(2) Weitere Angaben

450	Konditionenbeitrag⁴	450	_____
460	Aktivgeschäft ⁴	460	_____
470	Passivgeschäft ⁴	470	_____
480	Strukturbeitrag⁴	480	_____
490	Rechnungslegungsstandard: HGB (= 1), IFRS (= 2)	490	_____

¹ Institute gemäß § 1 Absatz 1b KWG sowie weitere nach § 10a Absatz 1 Satz 2, 4 bis 8 und Absatz 2 in Verbindung mit Absatz 3 KWG einzubeziehende Unternehmen.

² 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.

³ Gemäß aktuellem Rundschreiben zum Zinsänderungsrisiko der BaFin.

⁴ Vorzeichen angeben.

Größere Veränderungen einzelner Positionen bitte gesondert erläutern.