

ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	70	80	90	100
--------	---------	---------	--------	----	----	----	----	----	----	----	----	----	-----

1. Kapitalmarktorientierung

10 Sind die zusätzlichen Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement für kapitalmarktorientierte Institute i.S. der MaRisk einzuhalten?

2. Umfang des Liquiditätsrisikomanagements

20 1

Welche Arten von Liquiditätsrisiken werden im Rahmen der Risikoinventur identifiziert?					
Risikoart	Unterkategorie	Einstufung als wesentliches Risiko i.S. der MaRisk	Berechnungsintervall	Definition / Abgrenzung der Risikoarten	Erläuterung
▼	▼		▼		

+ Risikoart hinzufügen

30 1 1

▼	▼		▼		
---	---	--	---	--	--

+ Unterkategorie hinzufügen

40 Erläuterungen:

50 1

Welche wesentlichen Liquiditätsrisiken aus Fremdwährungen bestehen?	
Fremdwährung	Volumina in % der Verbindlichkeiten
▼	

+ Fremdwährung hinzufügen

60 Erläuterungen:

ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	70	80	90	100
--------	---------	---------	--------	----	----	----	----	----	----	----	----	----	-----

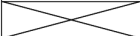
3. Steuerungskennzahlen

Werden Kennzahlen zur Steuerung des Liquiditätsrisiko herangezogen?

Falls ja, bitte geben Sie die Höhe an:

70

Liquidity Coverage Ratio (LCR)

Weitere Kennzahlen (vordefiniert)	Zielgröße (minimum)	Zielgröße (maximum)	Höhe zum aktuellen Meldestichtag	Internes Limit	Falls es eine Limitverletzung (seit letztem Meldestichtag) gab oder sich abgezeichnet hat, wurden Maßnahmen ergriffen? Wenn ja, welche? (falls zutreffend)	Berechnungsintervall	Erläuterungen / Definition
						▼	

80

Weitere Steuerungskennzahlen (prozentuale)

▼						▼	
---	--	--	--	--	--	---	--

+ Steuerungskennzahl hinzufügen

90

Weitere Steuerungskennzahlen (ganzzahlige)

▼						▼	
---	--	--	--	--	--	---	--

+ Steuerungskennzahl hinzufügen

100

Weitere Steuerungskennzahlen (monetäre)

▼						▼	
---	--	--	--	--	--	---	--

+ Steuerungskennzahl hinzufügen

110

Erläuterungen:

ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	70	80	90	100																																																																																																																		
<p>4. Aufbau der Liquiditätsübersicht</p> <div style="display: flex; align-items: flex-start;"> <div style="width: 150px;"> <p>Tägliche Rasterung bis</p> <p>Wöchentliche Rasterung bis</p> <p>Monatliche Rasterung bis</p> <p>Gesamtzeithorizont der Liquiditätsübersicht</p> <p>Erläuterungen:</p> </div> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-left: 10px;"> <p style="text-align: center;">Untergliederung der Zeitbänder</p> <div style="border-bottom: 1px solid black; text-align: center;">▼</div> <div style="border-bottom: 1px solid black; text-align: center;">▼</div> <div style="border-bottom: 1px solid black; text-align: center;">▼</div> <div style="border-bottom: 1px solid black; text-align: center;">▼</div> </div> </div>																																																																																																																															
<p>5. Abflussannahmen für das Stressszenario gemäß MaRisk</p> <table border="1" style="width:100%; border-collapse: collapse; margin-top: 10px;"> <thead> <tr> <th colspan="6" style="text-align: center;">Abflussannahmen im Stressszenario gemäß MaRisk in %</th> </tr> <tr> <th style="width: 15%;">Unterkategorie</th> <th style="width: 15%;">1 Woche (kumuliert)</th> <th style="width: 15%;">1 Monat (kumuliert)</th> <th style="width: 15%;">bis 3 Monate (kumuliert)</th> <th colspan="2" style="width: 40%;">Erläuterungen / Definition</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Spareinlagen mit dreimonatiger Kündigungsfrist</td> <td style="text-align: center;">X</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>↳ darunter Unterkategorie</td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6" style="text-align: center;">± Unterkategorie hinzufügen</td> </tr> <tr> <td>Täglich fällige Einlagen von Retailkunden</td> <td style="text-align: center;">X</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>↳ darunter Unterkategorie</td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6" style="text-align: center;">± Unterkategorie hinzufügen</td> </tr> <tr> <td>Täglich fällige Verbindlichkeiten gegenüber Unternehmen</td> <td style="text-align: center;">X</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>↳ darunter Unterkategorie</td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6" style="text-align: center;">± Unterkategorie hinzufügen</td> </tr> <tr> <td>Täglich fällige Verbindlichkeiten gegenüber Institutionellen Anlegern</td> <td style="text-align: center;">X</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>↳ darunter Unterkategorie</td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6" style="text-align: center;">± Unterkategorie hinzufügen</td> </tr> </tbody> </table> <table border="1" style="width:100%; border-collapse: collapse; margin-top: 10px;"> <thead> <tr> <th colspan="6" style="text-align: center;">Inanspruchnahme im steuerrelevanten MaRisk-Szenario in %</th> </tr> <tr> <th style="width: 15%;">Unterkategorie</th> <th style="width: 15%;">1 Woche (kumuliert)</th> <th style="width: 15%;">1 Monat (kumuliert)</th> <th style="width: 15%;">bis 3 Monate (kumuliert)</th> <th colspan="2" style="width: 40%;">Erläuterungen / Definition</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Eingeräumte Liquiditäts- und Kreditlinien</td> <td style="text-align: center;">X</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>↳ darunter Unterkategorie</td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6" style="text-align: center;">± Unterkategorie hinzufügen</td> </tr> </tbody> </table> <p>Erläuterungen:</p>														Abflussannahmen im Stressszenario gemäß MaRisk in %						Unterkategorie	1 Woche (kumuliert)	1 Monat (kumuliert)	bis 3 Monate (kumuliert)	Erläuterungen / Definition		Spareinlagen mit dreimonatiger Kündigungsfrist	X					↳ darunter Unterkategorie	▼					± Unterkategorie hinzufügen						Täglich fällige Einlagen von Retailkunden	X					↳ darunter Unterkategorie	▼					± Unterkategorie hinzufügen						Täglich fällige Verbindlichkeiten gegenüber Unternehmen	X					↳ darunter Unterkategorie	▼					± Unterkategorie hinzufügen						Täglich fällige Verbindlichkeiten gegenüber Institutionellen Anlegern	X					↳ darunter Unterkategorie	▼					± Unterkategorie hinzufügen						Inanspruchnahme im steuerrelevanten MaRisk-Szenario in %						Unterkategorie	1 Woche (kumuliert)	1 Monat (kumuliert)	bis 3 Monate (kumuliert)	Erläuterungen / Definition		Eingeräumte Liquiditäts- und Kreditlinien	X					↳ darunter Unterkategorie	▼					± Unterkategorie hinzufügen					
Abflussannahmen im Stressszenario gemäß MaRisk in %																																																																																																																															
Unterkategorie	1 Woche (kumuliert)	1 Monat (kumuliert)	bis 3 Monate (kumuliert)	Erläuterungen / Definition																																																																																																																											
Spareinlagen mit dreimonatiger Kündigungsfrist	X																																																																																																																														
↳ darunter Unterkategorie	▼																																																																																																																														
± Unterkategorie hinzufügen																																																																																																																															
Täglich fällige Einlagen von Retailkunden	X																																																																																																																														
↳ darunter Unterkategorie	▼																																																																																																																														
± Unterkategorie hinzufügen																																																																																																																															
Täglich fällige Verbindlichkeiten gegenüber Unternehmen	X																																																																																																																														
↳ darunter Unterkategorie	▼																																																																																																																														
± Unterkategorie hinzufügen																																																																																																																															
Täglich fällige Verbindlichkeiten gegenüber Institutionellen Anlegern	X																																																																																																																														
↳ darunter Unterkategorie	▼																																																																																																																														
± Unterkategorie hinzufügen																																																																																																																															
Inanspruchnahme im steuerrelevanten MaRisk-Szenario in %																																																																																																																															
Unterkategorie	1 Woche (kumuliert)	1 Monat (kumuliert)	bis 3 Monate (kumuliert)	Erläuterungen / Definition																																																																																																																											
Eingeräumte Liquiditäts- und Kreditlinien	X																																																																																																																														
↳ darunter Unterkategorie	▼																																																																																																																														
± Unterkategorie hinzufügen																																																																																																																															

ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	70	80	90	100
--------	---------	---------	--------	----	----	----	----	----	----	----	----	----	-----

6. Haircuts der Positionen des Liquiditätspuffers

280

1

Abschläge bei den Positionen des Liquiditätspuffers im Stressszenario gemäß MaRisk in %			
Hauptkategorie	 	Abschlag	Definition / Abgrenzung der Positionen des Liquiditätspuffers
▼	 		

+ Hauptkategorie hinzufügen

290

1

1

Hauptkategorie	Unterkategorie	Abschlag	Definition / Abgrenzung der Positionen des Liquiditätspuffers
▼	▼		

+ Unterkategorie hinzufügen

Erläuterungen:

300

7. Liquiditätsstresstests

310

1

Bezeichnung des Stresstests	Art des Szenarios	Zugrunde liegende Annahme	Zugrunde liegender Zeithorizont (in Tagen)	Wird ein Überlebenshorizont ermittelt? Falls ja, geben Sie diesen bitte in Tagen an	Wird das Ergebnis limitiert? Wenn ja, wie?	Welche Maßnahmen wurden aufgrund des Stresstests beschlossen? (falls zutreffend)	Erläuterung	Berechnungsintervall	Validierungsintervall
	▼				▼	▼		▼	▼

+ Stresstest hinzufügen

Erläuterungen:

320

ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	70	80	90	100
--------	--------	--------	----	----	----	----	----	----	----	----	----	-----

8. Refinanzierungsplanung

		Bestand zum Stichtag	Planung 6 Monate	Planung 1 Jahr	Planung 2 Jahre	Planung 3 Jahre	Definition/ Abgrenzung
330	Bilanzielles Eigenkapital	 					
340	Fonds für allgemeine Bankrisiken nach § 340g HGB	 					
350	Privatkundeneinlagen	 					
360	Einlagen von Nicht-Finanzkunden	 					
370	Einlagen von Finanzkunden	 					
380	Kurzfristige Schuldverschreibungen (Ursprungslaufzeit < 1 Jahr)	 					
390	└ davon unbesichert	 					
400	└ davon besichert	 					
410	Langfristige Schuldverschreibungen (Ursprungslaufzeit ≥ 1 Jahr)	 					
420	└ davon unbesichert	 					
430	└ davon besichert	 					
440	1	Refinanzierungsquelle					
		+ Refinanzierungsquelle hinzufügen					
450		Refinanzierungsbedarf	Bedarf zum Stichtag	Planung 6 Monate	Planung 1 Jahr	Planung 2 Jahre	Planung 3 Jahre
460		Erläuterungen:					

9. Ergänzende Angaben und Erläuterungen

999