

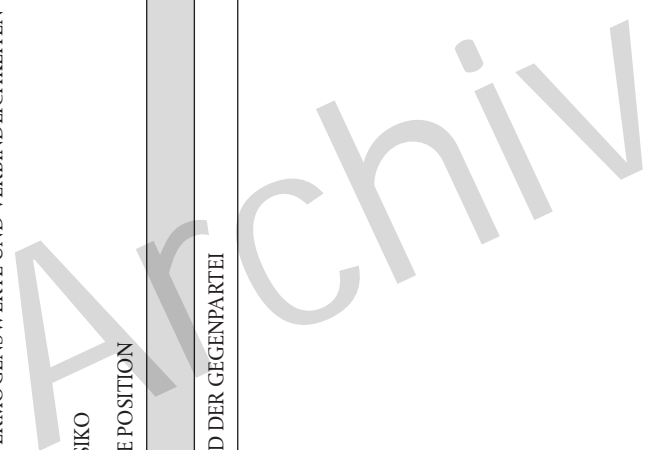
ANHANG I

BERICHTERSTATTUNG ÜBER EIGENMITTEL UND EIGENMITTELANFORDERUNGEN

		COREP-MELDEBÖGEN	
Meldebo- genummer	Meldebo- gencode	Angemessene Eigenkapitalausstattung	Bezeichnung des Meldebogens / der Meldebogengruppe
		Kurzbezeichnung	
			CA
1	C 01.00	EIGENMITTEL	CA 1
2	C 02.00	EIGENMITTELANFORDERUNGEN	CA 2
3	C 03.00	KAPITALQUOTEN	CA 3
4	C 04.00	ZUSATZINFORMATIONEN:	CA 4
		ÜBERGANGSBESTIMMUNGEN	CA 5
5.1	C 05.01	ÜBERGANGSBESTIMMUNGEN	CA 5.1
5.2	C 05.02	BESTANDSGESCHÜTZTE INSTRUMENTE: INSTRUMENTE, DIE KEINE STAATLICHEN BEIHILFEN DARSTELLEN	CA 5.2
		GRUPPENSOLVABILITÄT	GS
6.1	C 06.01	GRUPPENSOLVABILITÄT: ANGABEN ZU TOCHTERGESELLSCHAFTEN — SUMME	GS Total
6.2	C 06.02	GRUPPENSOLVABILITÄT: ANGABEN ZU TOCHTERGESELLSCHAFTEN	GS
		KREDITRISIKO	CR
7	C 07.00	KREDIT- UND GEGENPARTEIAUSFALLRISIKO SOWIE VORLEISTUNGEN: STANDARDANSATZ ZUR BESTIMMUNG DER EIGENKAPITALANFORDERUNGEN	CR SA
		KREDIT- UND GEGENPARTEIAUSFALLRISIKO SOWIE VORLEISTUNGEN: IRB-ANSATZ ZUR BESTIMMUNG DER EIGENKAPITALANFORDERUNGEN	CR IRB
8.1	C 08.01	KREDIT- UND GEGENPARTEIAUSFALLRISIKO SOWIE VORLEISTUNGEN: IRB-ANSATZ ZUR BESTIMMUNG DER EIGENKAPITALANFORDERUNGEN	CR IRB 1
8.2	C 08.02	KREDIT- UND GEGENPARTEIAUSFALLRISIKO SOWIE VORLEISTUNGEN: IRB-ANSATZ ZUR BESTIMMUNG DER EIGENKAPITALANFORDERUNGEN (Aufschlüsselung nach Ratingstufen oder Risikopools von Schuldner)	CR IRB 2
		GEOGRAFISCHE AUFGLIEDERUNG	CR GB
9.1	C 09.01	Tabelle 9.1 — Geografische Aufgliederung der Risikopositionen nach Sitzland des Schuldners (SA Risikopositionen)	CR GB 1

COREP-MELDEBÖGEN			Kurzbezeichnung
Meldebo- genummer	Meldebo- gencode	Bezeichnung des Meldebogens / der Meldebogengruppe	
9.2	C 09.02	Tabelle 9.2 — Geografische Aufgliederung der Risikopositionen nach Sitzland des Schuldners (IRB-Risikopositionen)	CR GB 2
9.4	C 09.04	Tabelle 9.4 — Aufschlüsselung der für die Berechnung des antizyklischen Kapitalpuffers nach Ländern und der Quote des institutsspezifischen antizyklischen Kapitalpuffers wesentlichen Kreditrisikopositionen	CCB
10.1	C 10.01	KREDITRISIKO: BETEILIGUNGEN — IRB-ANSÄTZE ZUR BESTIMMUNG DER EINKAPITALANFORDERUNGEN	CR EQU IRB
10.2	C 10.02	KREDITRISIKO: BETEILIGUNGEN — IRB-ANSÄTZE ZUR BESTIMMUNG DER EINKAPITALANFORDERUNGEN	CR EQU IRB 1
11	C 11.00	KREDITRISIKO: BETEILIGUNGEN — IRB-ANSÄTZE ZUR BESTIMMUNG DER EINKAPITALANFORDERUNGEN. AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTSUMME DER RISIKOPPOSITIONEN NACH RATINGSTUFEN IM RAHMEN DES PD/LGD-ANSATZES;	CR EQU IRB 2
13.1	C 13.01	ABWICKLUNGS-/LIEFERRISIKO	CR SETT
14	C 14.00	KREDITRISIKO: VERBRIEFUNGEN	CR SEC
14.1	C 14.01	DETAILLIERTE ANGABEN ZU VERBRIEFUNGEN	CR SEC Details
		DETAILLIERTE ANGABEN ZU VERBRIEFUNGEN NACH ANSATZ	CR SEC Details 2
		OPERATIONELLES RISIKO	OPR
16	C 16.00	OPERATIONELLES RISIKO	OPR
17.1	C 17.01	OPERATIONELLES RISIKO: VERLUSTE UND RÜCKFLÜSSE	OPR DETAILS 1
17.2	C 17.02	OPERATIONELLES RISIKO: VERLUSTE UND RÜCKFLÜSSE DES LETZTEN JAHRES NACH GESCHÄFTSFELDERN UND VERLUSTEREIGNISKATEGORIEN	OPR DETAILS 2
		OPERATIONELLES RISIKO: GROSSE VERLUSTEREIGNISSE	MKR
18	C 18.00	MARKTRISIKO: STANDARDANSATZ FÜR POSITIONSRISIKEN BÖRSEGEHANDELTER SCHULDTITEL	MKR SA TDI
19	C 19.00	MARKTRISIKO: STANDARDANSATZ FÜR SPEZIFISCHE RISIKEN IN VERBRIEFUNGEN	MKR SA SEC
20	C 20.00	MARKTRISIKO: STANDARDANSATZ FÜR DAS SPEZIFISCHE RISIKO IM KORRELATIONSHANDELSPORTFOLIO	MKR SA CTP
21	C 21.00	MARKTRISIKO: STANDARDANSATZ FÜR POSITIONSRISIKEN BEI AKTIENINSTRUMENTEN	MKR SA EQU
22	C 22.00	MARKTRISIKO: STANDARDANSATZ FÜR DAS FREMDWÄHRUNGSRISIKO	MKR SA FX

COREP-MELDEBÖGEN			
Meldebo- genummer	Meldebo- gencode	Bezeichnung des Meldebogens / der Meldebogengruppe	Kurzbezeichnung
23	C 23.00	MARKTRISIKO: STANDARDANSÄTZE FÜR WARENPOSITIONEN	MKR SA COM
24	C 24.00	INTERNE MARKTRISIKOMODELLE	MKR IM
25	C 25.00	KREDITWERTANPASSUNGSRISIKO	CVA
		VORSICHTIGE BEWERTUNG	MKR
32.1	C 32.01	VORSICHTIGE BEWERTUNG: ZEITWERTBILANZIERTE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN	PRUVAL 1
32.2	C 32.02	VORSICHTIGE BEWERTUNG: KERNANSATZ	PRUVAL 2
32.3	C 32.03	VORSICHTIGE BEWERTUNG: AVA FÜR DAS MODELLRISIKO	PRUVAL 3
32.4	C 32.04	VORSICHTIGE BEWERTUNG: AVA FÜR KONZENTRIERTE POSITION	PRUVAL 4
		RISIKOPOSITIONEN GEGENÜBER STAATEN	MKR
33	C 33.00	RISIKOPOSITIONEN GEGENÜBER STAATEN NACH LAND DER GEGENPARTEI	GOV



C 01.00 — EIGENMITTEL (CA1)			
Zeilen	ID	Posten	Betrag
010	1	<u>EIGENMITTEL</u>	
015	1.1	KERNKAPITAL (T1)	
020	1.1.1	HARTES KERNKAPITAL (CET1)	
030	1.1.1.1	Als hartes Kernkapital anrechenbare Kapitalinstrumente	
040	1.1.1.1.1	Eingezahlte Kapitalinstrumente	
045	1.1.1.1.1*	Davon: Von staatlichen Stellen im Notfall gezeichnete Kapitalinstrumente	
050	1.1.1.1.2*	Zusatzinformation: Nicht anrechenbare Kapitalinstrumente	
060	1.1.1.1.3	Agio	
070	1.1.1.1.4	(-) Eigene Instrumente des harten Kernkapitals	
080	1.1.1.1.4.1	(-) Direkte Positionen in Instrumenten des harten Kernkapitals	
090	1.1.1.1.4.2	(-) Indirekte Positionen in Instrumenten des harten Kernkapitals	
091	1.1.1.1.4.3	(-) Synthetische Positionen in Instrumenten des harten Kernkapitals	
092	1.1.1.1.5	(-) Bestehende oder eventuelle Verpflichtungen zum Kauf eigener Instrumente des harten Kernkapitals	
130	1.1.1.2	Einbehaltene Gewinne	
140	1.1.1.2.1	Einbehaltene Gewinne der Vorjahre	
150	1.1.1.2.2	Anrechenbarer Gewinn oder Verlust	
160	1.1.1.2.2.1	Den Eigentümern des Mutterunternehmens zurechenbare Gewinne oder Verluste	
170	1.1.1.2.2.2	(-) Teil des nicht anrechenbaren Zwischengewinns oder Gewinns zum Jahresende	
180	1.1.1.3	Kumuliertes sonstiges Ergebnis	
200	1.1.1.4	Sonstige Rücklagen	
210	1.1.1.5	Fonds für allgemeine Bankrisiken	
220	1.1.1.6	Anpassungen aufgrund der Übergangsbestimmungen zu Kapitalinstrumenten des harten Kernkapitals (Grandfathering)	
230	1.1.1.7	Zum harten Kernkapital zählende Minderheitsbeteiligungen (Minority interest)	
240	1.1.1.8	Anpassungen aufgrund der Übergangsbestimmungen zu zusätzlichen Minderheitsbeteiligungen	
250	1.1.1.9	Abzugs- und Korrekturposten aufgrund von Anpassungen des harten Kernkapitals (Prudential Filters)	
260	1.1.1.9.1	(-) Anstieg des Eigenkapitals aufgrund verbriefteter Aktiva	
270	1.1.1.9.2	Rücklagen aufgrund von Sicherungsgeschäften für Zahlungsströme (Cash Flow Hedge)	
280	1.1.1.9.3	Durch Veränderungen der eigenen Bonität bedingte Gewinne oder Verluste aus zum beizulegenden Zeitwert bewerteten eigenen Verbindlichkeiten	
285	1.1.1.9.4	Gewinne und Verluste aus zeitwertbilanzierten derivativen Verbindlichkeiten, die aus dem eigenen Kreditrisiko des Instituts resultieren	

Zeilen	ID	Posten	Betrag
290	1.1.1.9.5	(-) Wertberichtigungen aufgrund der Anforderungen für eine vorsichtige Bewertung	
300	1.1.1.10	(-) Geschäfts- oder Firmenwert (Goodwill)	
310	1.1.1.10.1	(-) Als immaterieller Vermögenswert bilanzierter Geschäfts- oder Firmenwert	
320	1.1.1.10.2	(-) In den Wertansätzen der wesentlichen Beteiligungen enthaltener Geschäfts- oder Firmenwert	
330	1.1.1.10.3	Mit dem Geschäfts- oder Firmenwert verbundene latente Steuerschulden	
340	1.1.1.11	(-) Sonstige immaterielle Vermögenswerte	
350	1.1.1.11.1	(-) Sonstige immaterielle Vermögenswerte vor Abzug latenter Steuerschulden	
360	1.1.1.11.2	Mit sonstigen immateriellen Vermögenswerten verbundene latente Steuerschulden	
370	1.1.1.12	(-) Von der künftigen Rentabilität abhängige, nicht aus temporären Differenzen resultierende latente Steueransprüche, abzüglich der verbundenen Steuerschulden	
380	1.1.1.13	(-) IRB-Fehlbetrag (IRB Shortfall) aus Kreditrisikoanpassungen an erwartete Verluste	
390	1.1.1.14	(-) Vermögenswerte aus Pensionsfonds mit Leistungszusage	
400	1.1.1.14.1	(-) Vermögenswerte aus Pensionsfonds mit Leistungszusage	
410	1.1.1.14.2	Mit den Vermögenswerten aus Pensionsfonds mit Leistungszusage verbundene latente Steuerschulden	
420	1.1.1.14.3	Vermögenswerte aus Pensionsfonds mit Leistungszusage, die das Institut uneingeschränkt nutzen darf	
430	1.1.1.15	(-) Überkreuzbeteiligungen am harten Kernkapital	
440	1.1.1.16	(-) Von den Posten des zusätzlichen Kernkapitals in Abzug zu bringende Posten, die das zusätzliche Kernkapital überschreiten	
450	1.1.1.17	(-) Qualifizierte Beteiligungen außerhalb des Finanzsektors, denen alternativ ein Risikogewicht von 1 250 % zugeordnet werden kann	
460	1.1.1.18	(-) Verbriefungspositionen, denen alternativ ein Risikogewicht von 1 250 % zugeordnet werden kann	
470	1.1.1.19	(-) Vorleistungen, denen alternativ ein Risikogewicht von 1 250 % zugeordnet werden kann	
471	1.1.1.20	(-) Positionen in einem Korb, für die ein Institut das Risikogewicht nicht nach dem IRB-Ansatz bestimmen kann und auf die alternativ ein Risikogewicht von 1 250 % angewendet werden kann	
472	1.1.1.21	(-) Beteiligungspositionen im Rahmen eines auf internen Modellen basierenden Ansatzes, auf die alternativ ein Risikogewicht von 1 250 % angewendet werden kann	
480	1.1.1.22	(-) Instrumente des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
490	1.1.1.23	(-) Abzugsfähige latente Steueransprüche, die von der künftigen Rentabilität abhängig sind und aus temporären Differenzen resultieren	
500	1.1.1.24	(-) Instrumente des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
510	1.1.1.25	(-) Den Schwellenwert von 17,65 % überschreitender Betrag	
520	1.1.1.26	Sonstige Anpassungen des harten Kernkapitals aufgrund von Übergangsbestimmungen	
524	1.1.1.27	(-) Zusätzliche, aufgrund von Artikel 3 CRR vorzunehmende Abzüge vom harten Kernkapital	

Zeilen	ID	Posten	Betrag
529	1.1.1.28	Bestandteile des harten Kernkapitals oder Abzüge vom harten Kernkapital – sonstige	
530	1.1.2	ZUSÄTZLICHES KERNKAPITAL	
540	1.1.2.1	Als zusätzliches Kernkapital anrechenbare Kapitalinstrumente	
550	1.1.2.1.1	Eingezahlte Kapitalinstrumente	
560	1.1.2.1.2*	Zusatzinformation: Nicht anrechenbare Kapitalinstrumente	
570	1.1.2.1.3	Agio	
580	1.1.2.1.4	(-) Eigene Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals	
590	1.1.2.1.4.1	(-) Direkte Positionen in Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals	
620	1.1.2.1.4.2	(-) Indirekte Positionen in Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals	
621	1.1.2.1.4.3	(-) Synthetische Positionen in Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals	
622	1.1.2.1.5	(-) Bestehende oder eventuelle Verpflichtungen zum Kauf eigener Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals	
660	1.1.2.2	Anpassungen aufgrund der Übergangsbestimmungen zu Kapitalinstrumenten des zusätzlichen Kernkapitals (Grandfathering)	
670	1.1.2.3	Zum zusätzlichen Kernkapital zählende, von Tochterunternehmen begebene Instrumente	
680	1.1.2.4	Anpassungen aufgrund der Übergangsbestimmungen zu im zusätzlichen Kernkapital zusätzlich anerkannten, von Tochterunternehmen begebenen Instrumenten	
690	1.1.2.5	(-) Überkreuzbeteiligungen am zusätzlichen Kernkapital	
700	1.1.2.6	(-) Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
710	1.1.2.7	(-) Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
720	1.1.2.8	(-) Von den Posten des Ergänzungskapitals in Abzug zu bringende Posten, die das Ergänzungskapital überschreiten	
730	1.1.2.9	Sonstige Anpassungen des zusätzlichen Kernkapitals aufgrund von Übergangsbestimmungen	
740	1.1.2.10	Von den Posten des zusätzlichen Kernkapitals in Abzug zu bringende Posten, die das zusätzliche Kernkapital überschreiten (Abzug vom harten Kernkapital)	
744	1.1.2.11	(-) Zusätzliche, aufgrund von Artikel 3 CRR vorzunehmende Abzüge vom zusätzlichen Kernkapital	
748	1.1.2.12	Bestandteile des zusätzlichen Kernkapitals oder Abzüge vom zusätzlichen Kernkapital – sonstige	
750	1.2	ERGÄNZUNGSKAPITAL	
760	1.2.1	Als Ergänzungskapital anrechenbare Kapitalinstrumente und nachrangige Darlehen	
770	1.2.1.1	Eingezahlte Kapitalinstrumente und nachrangige Darlehen	
780	1.2.1.2*	Zusatzinformation: nicht anrechenbare Kapitalinstrumente und nachrangige Darlehen	
790	1.2.1.3	Agio	
800	1.2.1.4	(-) Eigene Instrumente des Ergänzungskapitals	
810	1.2.1.4.1	(-) Direkte Positionen in Instrumenten des Ergänzungskapitals	
840	1.2.1.4.2	(-) Indirekte Positionen in Instrumenten des Ergänzungskapitals	
841	1.2.1.4.3	(-) Synthetische Positionen in Instrumenten des Ergänzungskapitals	
842	1.2.1.5	(-) Bestehende oder eventuelle Verpflichtungen zum Kauf eigener Instrumente des Ergänzungskapitals	

Zeilen	ID	Posten	Betrag
880	1.2.2	Anpassungen aufgrund der Übergangsbestimmungen zu Kapitalinstrumenten des Ergänzungskapitals und nachrangiger Darlehen (Grandfathering)	
890	1.2.3	Zum Ergänzungskapital zählende, von Tochterunternehmen begebene Instrumente	
900	1.2.4	Anpassungen aufgrund der Übergangsbestimmungen zu im Ergänzungskapital zusätzlich anerkannten, von Tochterunternehmen begebenen Instrumenten	
910	1.2.5	Anrechenbare, die erwarteten Verluste überschreitende Rückstellungen nach IRB-Ansatz (IRB Excess)	
920	1.2.6	Allgemeine Kreditrisikoanpassungen nach dem Standardansatz	
930	1.2.7	(-) Überkreuzbeteiligungen am Ergänzungskapital	
940	1.2.8	(-) Instrumente des Ergänzungskapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
950	1.2.9	(-) Instrumente des Ergänzungskapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
960	1.2.10	Sonstige Anpassungen des Ergänzungskapitals aufgrund von Übergangsbestimmungen	
970	1.2.11	Von den Posten des Ergänzungskapitals in Abzug zu bringende Posten, die das Ergänzungskapital überschreiten (Abzug vom zusätzlichen Kernkapital)	
974	1.2.12	(-) Zusätzliche, aufgrund von Artikel 3 CRR vorzunehmende Abzüge vom Ergänzungskapital	
978	1.2.13	Bestandteile des Ergänzungskapitals oder Abzüge vom Ergänzungskapital — sonstige	

Archiv

C 02.00 — EIGENMITTELANFORDERUNGEN (CA2)

Zeilen	Posten	Bezeichnung	Betrag
010	1	<u>GESAMTRISIKOBETRAG</u>	
020	1*	Davon: Wertpapierfirmen im Sinne von Artikel 95 Absatz 2 und Artikel 98 der CRR	
030	1**	Davon: Wertpapierfirmen im Sinne von Artikel 96 Absatz 2 und Artikel 97 der CRR	
040	1.1	RISIKOGEWICHTETE POSITIONSBETRÄGE FÜR DAS KREDIT-, DAS GEGENPARTEIAUSFALL- UND DAS VERWÄSSERUNGSRISIKO SOWIE VORLEISTUNGEN	
050	1.1.1	Standardansatz (SA)	
051	1.1.1*	Davon: Zusätzliche, strengere Aufsichtsanforderungen auf der Grundlage von Artikel 124 CRR	
060	1.1.1.1	Risikopositionsklassen nach Standardansatz exklusive Verbriefungspositionen	
070	1.1.1.1.01	Staaten oder Zentralbanken	
080	1.1.1.1.02	Regionale oder lokale Gebietskörperschaften	
090	1.1.1.1.03	Öffentliche Stellen	
100	1.1.1.1.04	Multilaterale Entwicklungsbanken	
110	1.1.1.1.05	Internationale Organisationen	
120	1.1.1.1.06	Institute	
130	1.1.1.1.07	Unternehmen	
140	1.1.1.1.08	Mengengeschäft	
150	1.1.1.1.09	Durch Hypotheken auf Immobilien besichert	
160	1.1.1.1.10	Ausgefallene Positionen	
170	1.1.1.1.11	Mit besonders hohem Risiko verbundene Positionen	
180	1.1.1.1.12	Gedekte Schuldverschreibungen	
190	1.1.1.1.13	Risikopositionen gegenüber Instituten und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung	
200	1.1.1.1.14	Organismen für Gemeinsame Anlagen (OGA)	
210	1.1.1.1.15	Beteiligungen	
211	1.1.1.1.16	Sonstige Positionen	
240	1.1.2	Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRB-Ansatz)	
241	1.1.2*	Davon: Zusätzliche, strengere Aufsichtsanforderungen auf der Grundlage von Artikel 164 CRR	
242	1.1.2**	Davon: Zusätzliche, strengere Aufsichtsanforderungen auf der Grundlage von Artikel 124 CRR	
250	1.1.2.1	IRB-Ansätze, wenn weder eigene Schätzungen der LGD noch Umrechnungsfaktoren genutzt werden	
260	1.1.2.1.01	Zentralstaaten und Zentralbanken	
270	1.1.2.1.02	Institute	
280	1.1.2.1.03	Unternehmen — KMU	

Zeilen	Posten	Bezeichnung	Betrag
290	1.1.2.1.04	Unternehmen — Spezialfinanzierungen	
300	1.1.2.1.05	Unternehmen — Sonstige	
310	1.1.2.2	IRB-Ansätze, wenn eigene Schätzungen der LGD bzw. Umrechnungsfaktoren genutzt werden	
320	1.1.2.2.01	Zentralstaaten und Zentralbanken	
330	1.1.2.2.02	Institute	
340	1.1.2.2.03	Unternehmen — KMU	
350	1.1.2.2.04	Unternehmen — Spezialfinanzierungen	
360	1.1.2.2.05	Unternehmen — Sonstige	
370	1.1.2.2.06	Mengengeschäft — Durch Immobilien besichert, KMU	
380	1.1.2.2.07	Mengengeschäft — Durch Immobilien besichert, keine KMU	
390	1.1.2.2.08	Mengengeschäft — Qualifiziert revolving	
400	1.1.2.2.09	Mengengeschäft — Sonstige KMU	
410	1.1.2.2.10	Mengengeschäft — Sonstige, keine KMU	
420	1.1.2.3	Beteiligungen nach IRB	
450	1.1.2.5	Sonstige Aktiva, ohne Kreditverpflichtungen	
460	1.1.3	Risikopositionsbetrag für Beiträge zum Ausfallfonds einer ZGP	
470	1.1.4	Verbriefungspositionen	
490	1.2	RISIKOPOSITIONSBETRAG FÜR ABWICKLUNGS- UND LIEFERRISIKEN	
500	1.2.1	Abwicklungs- und Lieferrisiko im Anlagebuch	
510	1.2.2	Abwicklungs- und Lieferrisiko im Handelsbuch	
520	1.3	GESAMTRISIKOBETRAG FÜR POSITIONS-, FREMDWÄHRUNGS- UND WARENPOSITIONSRISIKEN	
530	1.3.1	Risikopositionsbetrag für Positions-, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiken nach Standardansätzen (SA)	
540	1.3.1.1	Börsengehandelte Schuldtitel	
550	1.3.1.2	Beteiligungen	
555	1.3.1.3	Besonderer Ansatz für Positionsrisiken in OGA	
556	1.3.1.3*	Zusatzinformation: Ausschließlich in börsengehandelte Schuldtitel investierte OGA	
557	1.3.1.3**	Zusatzinformation: Ausschließlich in Eigenkapitalinstrumenten oder gemischten Instrumenten investierte OGA	
560	1.3.1.4	Devisen	
570	1.3.1.5	Warenpositionen	
580	1.3.2	Risikopositionsbetrag für Positions-, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiken nach internen Modellen (IM)	

Zeilen	Posten	Bezeichnung	Betrag
590	1.4	GESAMTRISIKOBETRAG FÜR OPERATIONELLE RISIKEN (OpR)	
600	1.4.1	Basisindikatoransatz (BIA) für operationelle Risiken (OpR)	
610	1.4.2	Standardansatz (SA) bzw. alternativer Standardansatz (ASA) für operationelle Risiken (OpR)	
620	1.4.3	Fortgeschrittene Messansätze (AMA) für operationelle Risiken (OpR)	
630	1.5	ZUSÄTZLICHER RISIKOPOSITIONSBETRAG AUFGRUND FIXER GEMEINKOSTEN	
640	1.6	GESAMTRISIKOBETRAG AUFGRUND ANPASSUNG DER KREDITBEWERTUNG (CVA)	
650	1.6.1	Fortgeschrittene Methode	
660	1.6.2	Standardmethode	
670	1.6.3	Auf OEM-Grundlage	
680	1.7	GESAMTRISIKOBETRAG IN BEZUG AUF GROSSKREDITE IM HANDELSBUCH	
690	1.8	SONSTIGE RISIKOPOSITIONSBETRÄGE	
710	1.8.2	Davon: Zusätzliche, strengere Aufsichtsanforderungen auf der Grundlage von Artikel 458 CRR	
720	1.8.2*	Davon: Anforderungen für Großkredite	
730	1.8.2**	Davon: Aufgrund geänderter Risikogewichte zur Bekämpfung von Spekulationsblasen bei Wohn- und Gewerbeimmobilien	
740	1.8.2***	Davon: Aufgrund von Risikopositionen innerhalb der Finanzbranche	
750	1.8.3	Davon: Zusätzliche, strengere Aufsichtsanforderungen auf der Grundlage von Artikel 459 CRR	
760	1.8.4	Davon: Zusätzlicher Risikopositionsbetrag aufgrund von Artikel 3 CRR	

C 03.00 — KAPITALQUOTEN UND KAPITALISIERUNGEN (CA3)

Zeilen	ID	Posten	Betrag
010	1	Harte Kernkapitalquote (CET1)	
020	2	Überschuss (+) bzw. Defizit (-) des harten Kernkapitals (CET1)	
030	3	Kernkapitalquote (T1)	
040	4	Überschuss (+) bzw. Defizit (-) des Kernkapitals (T1)	
050	5	Gesamtkapitalquote	
060	6	Überschuss (+) bzw. Defizit (-) der Gesamteigenmittel	
Zusatzinformationen: SREP-Gesamtkapitalanforderung (TSCR) Gesamtkapitalanforderung (OCR) und Eigenmittelzielkennziffer (Pillar 2 Guidance, P2G)			
130	13	SREP-Gesamtkapitalanforderung (TSCR)	
140	13*	TSCR: in Form von hartem Kernkapital	
150	13**	TSCR: in Form von Kernkapital	
160	14	Gesamtkapitalanforderung (OCR)	
170	14*	OCR: in Form von hartem Kernkapital	
180	14**	OCR: in Form von Kernkapital	
190	15	OCR und Eigenmittelzielkennziffer (P2G)	
200	15*	OCR und P2G: in Form von hartem Kernkapital	
210	15**	OCR und P2G: in Form von Kernkapital	

C 04.00 — ZUSATZINFORMATIONEN (CA4)

Zeile	ID	Posten	Spalte
Latente Steueransprüche und Steuerschulden			010
010	1	Latente Steueransprüche insgesamt	
020	1.1	Nicht von der künftigen Rentabilität abhängige latente Steueransprüche	
030	1.2	Von der künftigen Rentabilität abhängige nicht aus temporären Differenzen resultierende latente Steueransprüche	
040	1.3	Von der künftigen Rentabilität abhängige, aus temporären Differenzen resultierende latente Steueransprüche	
050	2	Latente Steuerschulden insgesamt	
060	2.1	Latente Steuerschulden, die nicht von latenten, von der künftigen Rentabilität abhängigen Steueransprüchen abgezogen werden können	
070	2.2	Latente Steuerschulden, die von latenten, von der künftigen Rentabilität abhängigen Steueransprüchen abgezogen werden können	
080	2.2.1	Abzugsfähige, latente Steuerschulden, die mit von der künftigen Rentabilität abhängigen, nicht aus temporären Differenzen resultierenden latenten Steueransprüchen verbunden sind	
090	2.2.2	Abzugsfähige, latente Steuerschulden, die mit von der künftigen Rentabilität abhängigen, aus temporären Differenzen resultierenden latenten Steueransprüchen verbunden sind	
093	2A	Steuerüberzahlungen und Verlustrückträge	
096	2B	Latente Steueransprüche mit einem Risikogewicht von 250 %	
097	2C	Latente Steueransprüche mit einem Risikogewicht von 0 %	
Kreditrisikoanpassungen und erwartete Verluste			
100	3	Nach dem IRB-Ansatz berechneter positiver (+) oder negativer Betrag (-) bei Anpassungen des Kreditrisikos, zusätzlichen Wertberichtigungen und sonstigen Senkungen der Eigenmittel zur Anpassung an erwartete Verlustbeträge bei nicht ausgefallenen Risikopositionen	
110	3.1	Gesamtbetrag der Kreditrisikoanpassungen, zusätzlichen Wertberichtigungen und sonstigen Senkungen der Eigenmittel, die in die Berechnung des erwarteten Verlustbetrags einbezogen werden können	
120	3.1.1	Allgemeine Kreditrisikoanpassungen	
130	3.1.2	Spezifische Kreditrisikoanpassungen	
131	3.1.3	Zusätzliche Wertberichtigungen und sonstige Senkungen der Eigenmittel	
140	3.2	Gesamtbetrag der erwarteten anrechenbaren Verluste	
145	4	Nach dem IRB-Ansatz berechneter positiver (+) oder negativer Betrag (-) spezifischer Kreditrisikoanpassungen an erwartete Verluste bei ausgefallenen Risikopositionen	
150	4.1	Spezifische Kreditrisikoanpassungen und ähnlich behandelte Positionen	
155	4.2	Gesamtbetrag der erwarteten anrechenbaren Verluste	
160	5	Risikogewichtete Positionsbeträge für die Berechnung der Obergrenze des als Ergänzungskapital anrechenbaren Rückstellungsüberschusses	
170	6	Auf das Ergänzungskapital anrechenbare Bruttorekstellungen insgesamt	
180	7	Risikogewichtete Positionsbeträge für die Berechnung der Obergrenze der als Ergänzungskapital anrechenbaren Rückstellungen	

Zeile	ID	Posten	Spalte
Schwellenwerte für Abzüge des harten Kernkapitals			
190	8	Nicht abzugsfähiger Schwellenwert von Beteiligungen an Unternehmen der Finanzbranche, an denen ein Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
200	9	10 %-Schwellenwert für das harte Kernkapital	
210	10	17,65 %-Schwellenwert für das harte Kernkapital	
225	11.1	Für die Zwecke von qualifizierten Beteiligungen außerhalb der Finanzbranche anrechenbare Eigenmittel	
226	11.2	Für die Zwecke von Großkrediten anrechenbare Eigenmittel	
Beteiligungen am Kapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält			
230	12	Positionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält, abzüglich der Verkaufspositionen	
240	12.1	Direkte Positionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
250	12.1.1	Direkte Bruttonpositionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
260	12.1.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen direkten Bruttonpositionen	
270	12.2	Indirekte Positionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
280	12.2.1	Indirekte Bruttonpositionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
290	12.2.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen indirekten Bruttonpositionen	
291	12.3	Synthetische Positionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
292	12.3.1	Synthetische Bruttonpositionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
293	12.3.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen synthetischen Bruttonpositionen	
300	13	Positionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält, abzüglich der Verkaufspositionen	
310	13.1	Direkte Positionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
320	13.1.1	Direkte Bruttonpositionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
330	13.1.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen direkten Bruttonpositionen	
340	13.2	Indirekte Positionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
350	13.2.1	Indirekte Bruttonpositionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	

Zeile	ID	Posten	Spalte
360	13.2.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen indirekten Bruttositionen	
361	13.3	Synthetische Positionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
362	13.3.1	Synthetische Bruttositionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
363	13.3.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen synthetischen Bruttositionen	
370	14	Beteiligungen am Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält, abzüglich der Verkaufspositionen	
380	14.1	Direkte Positionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
390	14.1.1	Direkte Bruttositionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
400	14.1.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen direkten Bruttositionen	
410	14.2	Indirekte Positionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
420	14.2.1	Indirekte Bruttositionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
430	14.2.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen indirekten Bruttositionen	
431	14.3	Synthetische Positionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
432	14.3.1	Synthetische Bruttositionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält	
433	14.3.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen synthetischen Bruttositionen	
Beteiligungen am Kapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält			
440	15	Positionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält, abzüglich der Verkaufspositionen	
450	15.1	Direkte Positionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
460	15.1.1	Direkte Bruttositionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
470	15.1.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen direkten Bruttositionen	
480	15.2	Indirekte Positionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
490	15.2.1	Indirekte Bruttositionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
500	15.2.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen indirekten Bruttositionen	

Zeile	ID	Posten	Spalte
501	15.3	Synthetische Positionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
502	15.3.1	Synthetische Bruttositionen im harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
503	15.3.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen synthetischen Bruttositionen	
510	16	Positionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält, abzüglich der Verkaufspositionen	
520	16.1	Direkte Positionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
530	16.1.1	Direkte Bruttositionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
540	16.1.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen direkten Bruttositionen	
550	16.2	Indirekte Positionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
560	16.2.1	Indirekte Bruttositionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
570	16.2.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen indirekten Bruttositionen	
571	16.3	Synthetische Positionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
572	16.3.1	Synthetische Bruttositionen im zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
573	16.3.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen synthetischen Bruttositionen	
580	17	Positionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält, abzüglich der Verkaufspositionen	
590	17.1	Direkte Positionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
600	17.1.1	Direkte Bruttositionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
610	17.1.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen direkten Bruttositionen	
620	17.2	Indirekte Positionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
630	17.2.1	Indirekte Bruttositionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
640	17.2.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen indirekten Bruttositionen	

Zeile	ID	Posten	Spalte
641	17.3	Synthetische Positionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
642	17.3.1	Synthetische Bruttositionen im Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	
643	17.3.2	(-) Zulässige Verrechnung von Verkaufspositionen in Bezug auf die oben eingeschlossenen synthetischen Bruttositionen	
Gesamtrisikobeträge von Beteiligungen, die nicht von der entsprechenden Kapitalkategorie abgezogen werden:			
650	18	Risikogewichtete Positionsbeträge von Anteilen am harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, die nicht vom harten Kernkapital des Instituts abgezogen werden	
660	19	Risikogewichtete Positionsbeträge von Anteilen am zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, die nicht vom zusätzlichen Kernkapital des Instituts abgezogen werden	
670	20	Risikogewichtete Positionsbeträge von Anteilen am Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, die nicht vom Ergänzungskapital des Instituts abgezogen werden	
Befristete Ausnahme vom Abzug von Eigenmitteln (Waiver)			
680	21	Positionen in Kapitalinstrumenten des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält, mit befristeter Ausnahme	
690	22	Positionen in Kapitalinstrumenten des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält, mit befristeter Ausnahme	
700	23	Positionen in Kapitalinstrumenten des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält, mit befristeter Ausnahme	
710	24	Positionen in Kapitalinstrumenten des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält, mit befristeter Ausnahme	
720	25	Positionen in Kapitalinstrumenten des Ergänzungskapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält, mit befristeter Ausnahme	
730	26	Positionen in Kapitalinstrumenten des Ergänzungskapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält, mit befristeter Ausnahme	
Kapitalpuffer			
740	27	Kombinierte Kapitalpufferanforderung	
750		Kapitalerhaltungspuffer	
760		Kapitalerhaltungspuffer aufgrund von Makroaufsichtsrisiken oder Systemrisiken auf Ebene eines Mitgliedstaats	
770		Institutsspezifischer antizyklischer Kapitalpuffer	
780		Systemrisikopuffer	
800		Puffer für global systemrelevante Institute	
810		Puffer für sonstige systemrelevante Institute	
Anforderungen der Säule II			
820	28	Eigenmittelanforderungen aufgrund von Anpassungen nach Säule II	

Zeile	ID	Posten	Spalte
Zusatzangaben für Wertpapierfirmen			
830	29	Anfangskapital	
840	30	Eigenmittel auf der Grundlage der fixen Gemeinkosten	
Zusatzangaben für die Berechnung der Schwellenwerte für Meldungen			
850	31	Ausländische ursprüngliche Risikopositionen	
860	32	Ursprüngliche Risikopositionen insgesamt	
Basel-I-Untergrenze			
870		Anpassungen der Gesamteigenmittel	
880		Eigenmittel vollständig angepasst an die Basel-I-Untergrenze	
890		Eigenmittelanforderungen nach der Basel-I-Untergrenze	
900		Eigenmittelanforderungen nach der Basel-I-Untergrenze — Alternative zum Standardansatz (SA)	
910		Defizit der Gesamteigenmittel im Hinblick auf die Mindestanforderungen an Eigenmittel nach der Basel-I-Untergrenze	

Archiv

C 05.01 — ÜBERGANGSBESTIMMUNGEN (CA5.1)		Posten		Anpassungen des harten Kernkapitals	Anpassungen des zusätzlichen Kernkapitals	Anpassungen des Ergänzungskapitals	In die risikogewichteten Aktiva (RWA) aufgenommene Anpassungen	Zusatzinformationen	
Code	ID	ANPASSUNGEN INSGESAMT	Anwendbarer Prozentsatz					Anrechenbarer Betrag ohne Übergangsbestimmungen	
010	1	ANPASSUNGEN INSGESAMT		010	020	030	040	050	060
020	1.1	BESTANDSGESCHÜTZTE INSTRUMENTE		Verknüpfung mit {CA1;r:220}	Verknüpfung mit {CA1;r:660}	Verknüpfung mit {CA1;r:880}			
030	1.1.1	Bestandsgeschützte Instrumente, die staatliche Beihilfen darstellen							
040	1.1.1.1	Nach Richtlinie 2006/48/EG als Eigenmittel geltende Instrumente							
050	1.1.1.2	Instrumente, die von Instituten begeben wurden, die ihren Sitz in einem Mitgliedstaat haben, der ein wirtschaftliches Anpassungsprogramm durchführen muss							
060	1.1.2	Instrumente, die keine staatlichen Beihilfen darstellen		Verknüpfung mit {CA5.2;r:010;c:060}	Verknüpfung mit {CA5.2;r:020;c:060}	Verknüpfung mit {CA5.2;r:090;c:060}			
070	1.2	MINDERHEITSBETEILIGUNGEN UND GLEICHWERTIGE BETEILIGUNGEN		Verknüpfung mit {CA1;r:240}	Verknüpfung mit {CA1;r:680}	Verknüpfung mit {CA1;r:900}			
080	1.2.1	Nicht als Minderheitsbeteiligungen geltende Kapitalinstrumente und Positionen							
090	1.2.2	Vorübergehende Anerkennung von Minderheitsbeteiligungen in den konsolidierten Eigenmitteln							
091	1.2.3	Vorübergehende Anerkennung von qualifiziertem zusätzlichem Kernkapital in den konsolidierten Eigenmitteln							
092	1.2.4	Vorübergehende Anerkennung von qualifiziertem Ergänzungskapital in den konsolidierten Eigenmitteln							

Code	ID	Posten	Anpassungen des harten Kernkapitals	Anpassungen des zusätzlichen Kernkapitals	Anpassungen des Ergänzungskapitals	In die risikogewichteten Aktiva (RWA) aufgenommene Anpassungen	Zusatzinformationen	
							Anwendbarer Prozentsatz	Anrechenbarer Betrag ohne Übergangsbestimmungen
100	1.3	SONSTIGE ANPASSUNGEN AUFGRUND VON ÜBERGANGSBESTIMMUNGEN	010	020	030	040	050	060
110	1.3.1	Nicht realisierte Gewinne und Verluste						
120	1.3.1.1	Nicht realisierte Gewinne						
130	1.3.1.2	Nicht realisierte Verluste						
133	1.3.1.3.	Nicht realisierte Gewinne aus Risikopositionen gegenüber Staaten der Kategorie ‚zur Veräußerung verfügbar‘ des von der Union übernommenen internationalen Rechnungslegungsstandards IAS 39						
136	1.3.1.4.	Nicht realisierter Verluste aus Risikopositionen gegenüber Staaten der Kategorie ‚zur Veräußerung verfügbar‘ des von der Union übernommenen internationalen Rechnungslegungsstandards IAS 39						
138	1.3.1.5.	Gewinne und Verluste aus zeitwertbilanzierten derivativen Verbindlichkeiten, die aus dem eigenen Kreditrisiko des Instituts resultieren						
140	1.3.2	Abzüge						
150	1.3.2.1	Verluste des laufenden Geschäftsjahres						
160	1.3.2.2	Immaterielle Vermögenswerte						
170	1.3.2.3	Von der künftigen Rentabilität abhängige nicht aus temporären Differenzen resultierende latente Steueransprüche						
180	1.3.2.4	Nach dem IRB-Ansatz berechneter negativer Betrag der Rückstellungen für erwartete Verluste						
190	1.3.2.5	Vermögenswerte von Pensionsfonds mit Leistungszusage						
194	1.3.2.5*	davon: Änderungen des internationalen Rechnungslegungsstandards IAS 19 — positiver Posten						
198	1.3.2.5**	davon: Änderungen des internationalen Rechnungslegungsstandards IAS 19 — negativer Posten						

Code	ID	Posten	Anpassungen des harten Kernkapitals	Anpassungen des zusätzlichen Kernkapitals	Anpassungen des Ergän- zungskapitals	In die risiko- gewichteten Aktiva (RWA) aufgenommene Anpassungen	Zusatzinformationen	
							Anwendbarer Prozentsatz	Anrechenbarer Betrag ohne Über- gangsbestimmun- gen
200	1.3.2.6	Eigene Instrumente	010	020	030	040	050	060
210	1.3.2.6.1	Eigene Instrumente des harten Kernkapitals						
211	1.3.2.6.1.**	davon: Direkte Beteiligungen						
212	1.3.2.6.1.*	davon: Indirekte Beteiligungen						
220	1.3.2.6.2	Eigene Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals						
221	1.3.2.6.2.**	davon: Direkte Beteiligungen						
222	1.3.2.6.2.*	davon: Indirekte Beteiligungen						
230	1.3.2.6.3	Eigene Instrumente des Ergänzungskapitals						
231	1.3.2.6.3.*	davon: Direkte Beteiligungen						
232	1.3.2.6.3.**	davon: Indirekte Beteiligungen						
240	1.3.2.7	Überkreuzbeteiligungen						
250	1.3.2.7.1	Überkreuzbeteiligungen am harten Kernkapital						
260	1.3.2.7.1.1	Überkreuzbeteiligungen am harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält						
270	1.3.2.7.1.2	Überkreuzbeteiligungen am harten Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält						
280	1.3.2.7.2	Überkreuzbeteiligungen am zusätzlichen Kernkapital						
290	1.3.2.7.2.1	Überkreuzbeteiligungen am zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält						

Code	ID	Posten	Anpassungen des harten Kernkapitals	Anpassungen des zusätzlichen Kernkapitals	Anpassungen des Ergänzungskapitals	In die risiko-gewichteten Aktiva (RWA) aufgenommene Anpassungen	Zusatzinformationen	
							Anwendbarer Prozentsatz	Anrechenbarer Betrag ohne Übergangsbestimmungen
300	1.3.2.7.2.2	Überkreuzbeteiligungen am zusätzlichen Kernkapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	010	020	030	040	050	060
310	1.3.2.7.3	Überkreuzbeteiligungen am Ergänzungskapital						
320	1.3.2.7.3.1	Überkreuzbeteiligungen am Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält						
330	1.3.2.7.3.2	Überkreuzbeteiligungen am Ergänzungskapital von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält						
340	1.3.2.8	Eigenmittelinstrumente von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält						
350	1.3.2.8.1	Instrumente des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält						
360	1.3.2.8.2	Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält						
370	1.3.2.8.3	Instrumente des Ergänzungskapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält						
380	1.3.2.9	Latente Steueransprüche, die von der künftigen Rentabilität abhängig sind und aus temporären Differenzen resultieren, sowie Instrumente des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält						
385	1.3.2.9a	Von der künftigen Rentabilität abhängige, aus temporären Differenzen resultierende latente Steueransprüche						
390	1.3.2.10	Eigenmittelinstrumente von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält						

Code	ID	Posten	Anpassungen des harten Kernkapitals	Anpassungen des zusätzlichen Kernkapitals	Anpassungen des Ergänzungskapitals	In die risikogewichteten Aktiva (RWA) aufgenommene Anpassungen	Zusatzinformationen	
							Anwendbarer Prozentsatz	Anrechenbarer Betrag ohne Übergangsbestimmungen
400	1.3.2.10.1	Instrumente des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	010	020	030	040	050	060
410	1.3.2.10.2	Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält						
420	1.3.2.10.3	Instrumente des Ergänzungskapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält						
425	1.3.2.11	Ausnahmen vom Abzug von Beteiligungen an Versicherungsunternehmen von Posten des harten Kernkapitals						
430	1.3.3	Zusätzliche Korrekturposten sowie Abzüge						
440	1.3.4	Aufgrund von Übergangsregelungen nach IFRS 9 vorzunehmende Anpassungen						

C 05.02 — BESTANDSGESCHÜTZTE INSTRUMENTE: INSTRUMENTE, DIE KEINE STAATLICHEN BEIHILFEN DARSTELLEN (CA 5.2)									
CA 5.2. Unter Bestandsschutz stehende Instrumente (Grandfathering): Instrumente, die keine staatlichen Beihilfen darstellen		Betrag der Instrumente zuzüglich des damit verbundenen Agios	Berechnungsgrundlage für die Obergrenze	Anwendbarer Prozentsatz	Obergrenze	(-) Die Bestandsschutzobergrenze übersteigender Betrag	Gesamtbetrag der unter Bestandsschutz stehenden Posten		
Code	ID	Posten	010	020	030	040	050	060	
010	1.	Nach Artikel 57 Buchstabe a der Richtlinie 2006/48/EG qualifizierte Instrumente						Verknüpfung mit {CA 5.1;r060;c010}	
020	2.	Instrumente, die — vorbehaltlich der Obergrenze nach Artikel 489 — nach Artikel 57 Buchstabe ca und Artikel 154 Absätze 8 und 9 der Richtlinie 2006/48/EG qualifiziert sind						Verknüpfung mit {CA 5.1;r060;c020}	
030	2.1	Instrumente ohne Kündigungsmöglichkeit oder Tilgungsanreiz insgesamt							
040	2.2.	Bestandsgeschützte Instrumente mit Kündigungsmöglichkeit und Tilgungsanreiz							
050	2.2.1	Instrumente mit einer nach dem Meldestichtag ausübbareren Kündigungsmöglichkeit, die nach dem effektiven Fälligkeitstermin die Bedingungen nach Artikel 52 der CRR erfüllen							
060	2.2.2	Instrumente mit einer nach dem Meldestichtag ausübbareren Kündigungsmöglichkeit, die nach dem effektiven Fälligkeitstermin die Bedingungen nach Artikel 52 der CRR nicht erfüllen							
070	2.2.3	Instrumente mit einer vor oder am 20. Juli 2011 ausübbareren Kündigungsmöglichkeit, die nach dem effektiven Fälligkeitstermin die Bedingungen nach Artikel 52 der CRR nicht erfüllen							
080	2.3	Die Obergrenze für bestandsgeschützte Instrumente des harten Kernkapitals überschreitender Betrag							

CA 5.2. Unter Bestandsschutz stehende Instrumente (Grandfathering): Instrumente, die keine staatlichen Beihilfen darstellen		Betrag der Instrumente zuzüglich des damit verbundenen Agios	Berechnungsgrundlage für die Obergrenze	Anwendbarer Prozentsatz	Obergrenze	(-) Die Bestandsschutzobergrenze übersteigender Betrag	Gesamtbetrag der unter Bestandsschutz stehenden Posten
Code	ID	Posten	020	030	040	050	060
090	3	Instrumente, die — vorbehaltlich der Obergrenze nach Artikel 490 — nach Artikel 57 Buchstaben e, f, g oder h der Richtlinie 2006/48/EG qualifiziert sind					Verknüpfung mit {CA5.1;r060;c030}
100	3.1	Posten ohne Tilgungsanreiz insgesamt					
110	3.2	Bestandsgeschützte Posten mit Tilgungsanreiz					
120	3.2.1	Posten mit einer nach dem Meldestichtag ausübbarer Kündigungsmöglichkeit, die nach dem effektiven Fälligkeitstermin die Bedingungen nach Artikel 63 der CRR erfüllen					
130	3.2.2	Posten mit einer nach dem Meldestichtag ausübbarer Kündigungsmöglichkeit, die nach dem effektiven Fälligkeitstermin die Bedingungen nach Artikel 63 der CRR nicht erfüllen					
140	3.2.3	Posten mit einer vor oder am 20. Juli 2011 ausübbarer Kündigungsmöglichkeit, die nach dem effektiven Fälligkeitstermin die Bedingungen nach Artikel 63 der CRR nicht erfüllen					
150	3.3	Die Obergrenze für bestandsgeschützte Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals überschreitender Betrag					

C 06.01 — GRUPPENSOLVABILITÄT: ANGABEN ZU TOCHTERGESELLSCHAFTEN — SUMME (GS TOTAL)

ANGABEN ZUM BEITRAG DER UNTERNEHMEN ZUR SOLVABILITÄT DER GRUPPE									
GESAMTRISIKOBETRAG		KREDITRISIKO, GEGENPARTER-AUSFALLRISIKO, VERWÄSSERUNGSRISIKO, VORLEISTUNGEN UND ABWICKLUNGS-/LIEFERRISIKO	POSITIONS-, FREMDWÄHRUNGS- UND WAREN-POSITIONSRISIKEN	OPERATIONELLES RISIKO	SONSTIGE RISIKOPORTFOLIOBETRÄGE	ZU DEN KONSOLIDIERTEN EIGENMITTELN ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE EIGENMITTEL	ZUM KONSOLIDIERTEN KERNKAPITAL ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE KERNKAPITAL-INSTRUMENTE	ZUM KONSOLIDIERTEN HARTEN KERNKAPITAL GE-RECHNETE MINDERHEITS-BETEILIGUNGEN	
010	GESAMT-SUMME	250	260	270	280	290	300	310	320

ANGABEN ZUM BEITRAG DER UNTERNEHMEN ZUR SOLVABILITÄT DER GRUPPE									
ZUM KONSOLIDIERTEN KERNKAPITAL ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE KERNKAPITAL-INSTRUMENTE		ZUM KONSOLIDIERTEN ERGÄNZUNGSKAPITAL ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE EIGENMITTELINSTRUMENTE	ZUSATZ-INFORMATION: GESCHÄFTS- ODER FIRMENWERT (-)/(+) NEGATIVER GESCHÄFTS- ODER FIRMENWERT	KONSOLIDIERTE EIGENMITTEL	DAVON: HARTES KERNKAPITAL	DAVON: ZUSÄTZLICHES KERNKAPITAL	DAVON: BEITRÄGE ZUM KONSOLIDIERTEN ERGEBNIS	DAVON: (-) GESCHÄFTS- ODER FIRMENWERT / (+) NEGATIVER GESCHÄFTS- ODER FIRMENWERT	
010	GESAMT-SUMME	330	340	350	360	370	380	390	400

KAPITALPUFFER								
KOMBINIERTE KAPITALPUFFERANFORDERUNGEN		KAPITALERHALTUNGSPUFFER	INSTITUTS-SPEZIFISCHER ANTIZYKLISCHER KAPITALPUFFER	KAPITALERHALTUNGSPUFFER AUFGRUND VON MAKROAUFSICHTSRISIKEN ODER SYSTEMRISIKEN AUF EBENE EINES MITGLIEDSTAATS	SYSTEMRISIKOPUFFER	PUFFER FÜR GLOBAL SYSTEM-RELEVANTE INSTITUTE	PUFFER FÜR SONSTIGE SYSTEMRELEVANTE INSTITUTE	
010	GESAMT-SUMME	410	420	430	440	450	470	480

ANGABEN ZUM BETRAG DER UNTERNEHMEN ZUR SOLVABILITÄT DER GRUPPE						
ZU DEN KONSOLIDierten EIGENMITTELN ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE EIGENMITTEL	ZUM KONSOLIDierten KERNKAPITAL ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE KERNKAPITALINSTRUMENTE	ZUM KONSOLIDierten HARTEN KERNKAPITAL GERECHNETE MINDERHEITSBETEILIGUNGEN	ZUM KONSOLIDierten ZUSÄTZLICHEN KERNKAPITAL ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE KERNKAPITALINSTRUMENTE	ZUM KONSOLIDierten ERGÄNZUNGSKAPITAL ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE EIGENMITTELINSTRUMENTE	ZUSÄTZLICHE INFORMATIONEN: GESCHÄFTS- ODER FIRMENWERT (-) / (+) NEGATIVER GESCHÄFTS- ODER FIRMENWERT	KONSOLIDIERTE EIGENMITTEL
300	310	320	330	340	350	360
						370

ANGABEN ZUM BETRAG DER UNTERNEHMEN ZUR SOLVABILITÄT DER GRUPPE						
KAPITALPUFFER						
ZU DEN KONSOLIDierten EIGENMITTELN ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE EIGENMITTEL	ZUM KONSOLIDierten ERGÄNZUNGSKAPITAL ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE EIGENMITTELINSTRUMENTE	ZUM KONSOLIDierten HARTEN KERNKAPITAL GERECHNETE MINDERHEITSBETEILIGUNGEN	ZUM KONSOLIDierten ZUSÄTZLICHEN KERNKAPITAL ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE KERNKAPITALINSTRUMENTE	ZUM KONSOLIDierten ERGÄNZUNGSKAPITAL ZÄHLENDE QUALIFIZIERTE EIGENMITTELINSTRUMENTE	ZUSÄTZLICHE INFORMATIONEN: GESCHÄFTS- ODER FIRMENWERT (-) / (+) NEGATIVER GESCHÄFTS- ODER FIRMENWERT	KONSOLIDIERTE EIGENMITTEL
380	390	400	410	420	430	440
						450
						470
						480

	RISIKOPOSITIONSWERT	DAVON: AUS DEM GEGEN- PARTEIAUSFALLRISIKO		RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG VOR ANWENDUNG DES KMU- FAKTORS	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG NACH ANWENDUNG DES KMU- FAKTORS	DAVON: MIT EINER BONITÄTSBEURTEILUNG DURCH EINE BENANNTE ECAI	DAVON: MIT EINER BONITÄTSBEURTEILUNG VON EINEM STAAT ABGELEITETEN BONITÄTSBEURTEILUNG	
		200	210					215
010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
015	davon: Ausgefallene Risikopositionen der Risikopositionsklassen ,mit besonders hohem Risiko verbundene Positionen' und ,Beteiligungspositionen'							
020	davon: KMU							
030	davon: dem KMU-Faktor unterliegende Risikopositionen							
040	davon: durch Hypotheken auf Immobilien besichert — Wohimmobilien							
050	davon: Risikopositionen mit dauerhafter Teilanwendung des Standardansatzes							
060	davon: Risikopositionen nach Standardansatz mit vorhe- riger Erlaubnis der Aufsichtsbehörden zur schrittweisen Einführung des IRB-Ansatzes							

AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPOSITIONEN NACH ART DER RISIKOPOSITION:

070	Einem Kreditrisiko unterliegende, bilanzwirksame Risikopositionen						
-----	---	--	--	--	--	--	--

	RISIKOPOSITIONSWERT	DAVON: AUS DEM GEGEN-PARTEIAUSFALLRISIKO	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG VOR ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG NACH ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS	DAVON: MIT EINER BONITÄTSBEURTEILUNG DURCH EINE BENANNTE ECAL	DAVON: MIT EINER BONITÄTSBEURTEILUNG VON EINEM STAAT ABGELEITETEN BONITÄTSBEURTEILUNG
080						
090						
100						
110						
120						
130						

AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPOSITIONEN NACH RISIKOGEWICHTEN

140	0 %					
150	2 %					
160	4 %					
170	10 %					
180	20 %					
190	35 %					
200	50 %					

	RISIKOPOSITIONSWERT		RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG VOR ANWENDUNG DES KMU- FAKTORS	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG NACH ANWENDUNG DES KMU- FAKTORS	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG NACH ANWENDUNG DES KMU- FAKTORS	DARON: MIT EINER BONITÄTSBEURTEILUNG DURCH EINE BENANNTE ECAF	DARON: MIT EINER BONITÄTSBEURTEILUNG VON EINEM STAAT ABGELEITETEN BONITÄTSBEURTEILUNG
	200	210					
210	70 %		215	220	230	240	
220	75 %						
230	100 %						
240	150 %						
250	250 %						
260	370 %						
270	1 250 %						
280	Sonstige Risikogewichte						
ZUSATZINFORMATIONEN							
290	Durch Grundpfandrechte auf Gewerbeimmobilien besicherte Risikopositionen						
300	Ausgefallene Risikopositionen mit einem Risikogewicht von 100 %						
310	Durch Grundpfandrechte auf Wohnimmobilien besicherte Risikopositionen						
320	Ausgefallene Risikopositionen mit einem Risikogewicht von 150 %						

C 08.01 — KREDIT- UND GEGENPARTELAUSFALLRISIKEN SOWIE VORLEISTUNGEN: IRB-ANSATZ ZUR BESTIMMUNG DER EIGENKAPITALANFORDERUNGEN (CR IRB 1)

Risikopositionsklasse nach IRB:
Eigene Schätzungen der LGD bzw. Umrechnungsfaktoren:

	INTERNES RATINGSYSTEM	URSPRÜNGLICHE RISIKOPOSITION VOR ANWENDUNG VON UMRECHNUNGSFAKTOREN	TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG (CRM) MIT SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUF DIE RISIKOPOSITION			SUBSTITUTION DER RISIKOPOSITION AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNG		
			ABSICHERUNG OHNE SICHERHEITSLAISTUNG	(-) ANDERE FORMEN DER BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLAISTUNG	(-) ABFLÜSSE INSGESAMT	ZUFLÜSSE INSGESAMT (+)		
	DER RATINGSTUFE ODER DEM RISIKOPOOL ZUGEWIESENE AUSFALLWAHRSCHEINLICHKEIT (PD) (%)	DAVON: GROSSE UNTERNEHMEN DER FINANZBRANCHE UND NICHT BEAUSICHTIGTE FINANZIELLE UNTERNEHMEN	(-) GARANTIE	(-) KREDITDERIVATE				
010	010	020	030	040	050	060	070	080
GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN								
015	davon: dem KMU-Faktor unterliegende Risikopositionen							
AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPOSITIONEN NACH ART DER RISIKOPOSITION:								
020	Einem Kreditrisiko unterliegende bilanzwirksame Risikopositionen							
030	Einem Kreditrisiko unterliegende außerbilanzielle Risikopositionen							
	Einem Gegenparteiausfallrisiko unterliegende Risikopositionen bzw. Geschäfte							
040	Wertpapierfinanzierungsgeschäfte							
050	Derivate und Geschäfte mit langer Abwicklungsfrist							
060	Aus produktübergreifenden vertraglichen Nettingvereinbarungen							
070	RATINGSTUFEN ODER RISIKOPOOLS ZUGEWIESENE RISIKOPOSITIONEN: GESAMTSUMME							
080	ZUORDNUNGSKRITERIEN FÜR SPEZIALFINANZIERUNGEN: GESAMTSUMME							

	RISIKOPOSITION NACH SUBSTITUTIONSEFFekten AUFGRUND VON KREDITRISIKO-MINDERUNGEN VOR DER ANWENDUNG VON UMRECHNUNGSAKTIVEN	RISIKOPOSITIONS-WERT				IN SCHÄTZUNGEN DER VERLUSTQUOTE BEI AUSFALL (LGD) BERÜCKSICHTIGTE TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG, OHNE DOPPELAUSFALLRISIKOBEHANDLUNG		
		DAVON: AUSSER-BILANZIELLE POSITIONEN	DAVON: AUSSER-BILANZIELLE POSITIONEN	DAVON: AUS DEM GEGENPARTIAUSFALLRISIKO	DAVON: GROSSE UNTERNEHMEN DER FINANZBRANCHE UND NICHT BEAUF SICHTIGTE FINANZIELLE UNTERNEHMEN			
	090	100	110	120	130	140	150	160
AUF SCHLÜSSELUNG SÄMTLICHER RISIKOPOSITIONEN, DIE ZU ORDNUNGSKRITERIEN FÜR SPEZIALFINANZIERUNGEN UNTERLIEGEN, NACH RISIKOGEWICHTEN								
090	RISIKOGEWICHT: 0 %							
100	50 %							
110	70 %							
120	Davon: in Kategorie 1							
130	90 %							
140	115 %							
150	250 %							
160	ALTERNATIVE BEHANDLUNG: DURCH IMMOBILIEN BESICHERT							
170	RISIKOPOSITIONEN AUS VORLEISTUNGEN MIT IM RAHMEN DER ALTERNATIVEN BEHANDLUNG ANGEWENDETEN RISIKOGEWICHTEN ODER RISIKOGEWICHTEN VON 100 % UND SONSTIGE RISIKOPOSITIONEN, FÜR DIE RISIKOGEWICHTE GELTEN							
180	VERWÄSSERUNGSRISIKO: ANGEKAUFTE RISIKOPOSITIONEN INSGESAMT							

	IN SCHÄTZUNGEN DER VERLUSTQUOTE BEI AUSFALL (LGD) BERÜCKSICHTIGTE TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG, OHNE DOPPELAUSEFALLRISIKOBEHANDLUNG						DER DOPPEL-AUSFALLRISIKOBEHANDLUNG UNTERLIEGEND		NACH RISIKOPOSITI-ONEN GEWICHTETE DURCHSCHNITTLICHE VERLUSTQUOTE BEI AUSFALL (LGD) FÜR GROSSE UNTERNEHMEN DER FINANZBRANCHE UND NICHT BEAUF-SICHTIGTE FINANZ-UNTERNEHMEN
	BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLISTUNG						ABSICHERUNG OHNE SICHERHEITSLISTUNG	NACH RISIKOPOSITI-ONEN GEWICHTETE DURCHSCHNITTLICHE VERLUSTQUOTE BEI AUSFALL (LGD) (%)	
	VERWENDUNG EIGENER LGD-SCHÄTZUNGEN: ANDERE FORMEN DER BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLISTUNG	ANRECHENBARE FINANZIELLE SICHERHEITEN	SONSTIGE ANRECHENBARE SICHERHEITEN		DER DOPPEL-AUSFALLRISIKOBEHANDLUNG UNTERLIEGEND				
	170	180	190	200	210	220	230	240	
010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN								
015	davon: dem KMU-Faktor unterliegende Risikopositionen								
AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPOSITIONEN NACH ART DER RISIKOPOSITION:									
020	Einem Kreditrisiko unterliegende bilanzwirksame Risikopositionen								
030	Einem Kreditrisiko unterliegende außerbilanzielle Risikopositionen								
Einem Gegenparteausfallrisiko unterliegende Risikopositionen bzw. Geschäfte									
040	Wertpapierfinanzierungsgeschäfte								
050	Derivate und Geschäfte mit langer Abwicklungsfrist								
060	Aus produktübergreifenden vertraglichen Nettingvereinbarungen								
070	RATINGSTUFEN ODER RISIKOPOOLS ZUGEWIESENE RISIKOPOSITIONEN: GESAMTSUMME								
080	ZUORDNUNGSKRITERIEN FÜR SPEZIALFINANZIERUNGEN: GESAMTSUMME								

	IN SCHÄTZUNGEN DER VERLUSTQUOTE BEI AUSFALL (LGD) BERÜCKSICHTIGTE TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG, OHNE DOPPELHAUSEALLRISIKOBEHANDLUNG				DER DOPPELHAUSEALLRISIKOBEHANDLUNG UNTERLIEGEND		NACH RISIKOPOSITIVEN GEWICHTETE DURCHSCHNITTliche VERLUSTQUOTE BEI AUSFALL (LGD) FÜR GROSSE UNTERNEHMEN DER FINANZBRANCHE UND NICHT BEAUF SICHTIGTE FINANZUNTERNEHMEN
	BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLAISTUNG				ABSICHERUNG OHNE SICHERHEITSLAISTUNG		
	VERWENDUNG EIGENER LGD-SCHÄTZUNGEN: ANDERE FORMEN DER BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLAISTUNG	ANRECHENBARE FINANZIELLE SICHERHEITEN	SONSTIGE ANRECHENBARE SICHERHEITEN				
	170	180	190	200	210	220	230
AUFSCHLÜSSELUNG SÄMTLICHER RISIKOPOSITIONEN, DIE ZUORDNUNGSKRITERIEN FÜR SPEZIALFINANZIERUNGEN UNTERLIEGEN, NACH RISIKOGEWICHTEN							
090	RISIKOGEWICHT: 0 %						
100	50 %						
110	70 %						
120	Davon: in Kategorie 1						
130	90 %						
140	115 %						
150	250 %						
160	ALTERNATIVE BEHANDLUNG: DURCH IMMOBILIEN BESICHERT						
170	RISIKOPOSITIONEN AUS VORLEISTUNGEN MIT IM RAHMEN DER ALTERNATIVEN BEHANDLUNG ANGEWENDETEN RISIKOGEWICHTEN ODER RISIKOGEWICHTEN VON 100 % UND SONSTIGE RISIKOPOSITIONEN, FÜR DIE RISIKOGEWICHTE GELTEN						
180	VERWÄSSERUNGSRISIKO: ANGEKAUFTE RISIKOPOSITIONEN INSGESAMT						

	NACH RISIKOPOSITIONEN GEWICHTETER DURCHSCHNITTSWERT DER LAUFZEIT (TAGE)	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG VOR ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG NACH ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS	ZUSATZINFORMATIONEN:		
				ERWARTETER VERLUSTBETRAG	(-) WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN	ANZAHL DER SCHULDNER
010	250	255	260	280	290	300
	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN					
015			Verknüpfung mit CA			
	davon: dem KMU-Faktor unterliegende Risikopositionen					
	AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPOSITIONEN NACH ART DER RISIKOPOSITION:					
020						
	Einem Kreditrisiko unterliegende bilanzwirksame Risikopositionen					
030						
	Einem Kreditrisiko unterliegende außerbilanzielle Risikopositionen					
	Einem Gegenparteausfallrisiko unterliegende Risikopositionen bzw. Geschäfte					
040						
	Wertpapierfinanzierungsgeschäfte					
050						
	Derivate und Geschäfte mit langer Abwicklungsfrist					
060						
	Aus produktübergreifenden vertraglichen Nettingvereinbarungen					
070						
	RATINGSSTUFEN ODER RISIKOPOOLS ZUGEWIESENE RISIKOPOSITIONEN: GESAMTSUMME					
080						
	ZUORDNUNGSKRITERIEN FÜR SPEZIALFINANZIERUNGEN: GESAMTSUMME					

	NACH RISIKOPOSITIVEN GEWICHTETER DURCHSCHNITTSWERT DER LAUFZEIT (TAGE)	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG VOR ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG NACH ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS		ZUSATZINFORMATIONEN:		
				DAVON: GROSSE UNTERNEHMEN DER FINANZBRANCHE UND NICHT BEAUFSICHTIGTE FINANZIELLE UNTERNEHMEN	ERWARTETER VERLUSTBETRAG	(-) WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN	ANZAHL DER SCHULDNER
	250	255	260	270	280	290	300
AUFSCHLÜSSELUNG SÄMTLICHER RISIKOPOSITIONEN, DIE ZU ORDNUNGSKRITERIEN FÜR SPEZIALFINANZIERUNGEN UNTERLIEGEN, NACH RISIKOGEWICHTEN							
090							
100							
110							
120							
130							
140							
150							
160							
170							
180							

C 08.02 — KREDIT- UND GEGENPARTEIAUSFALLRISIKEN SOWIE VORLEISTUNGEN: IRB-ANSATZ ZUR BESTIMMUNG DER EIGENKAPITALANFORDERUNGEN: AUFSCHLÜSSELUNG NACH RATINGSSTUFEN ODER RISIKOPOOLS VON SCHULDNERN (CR IRB 2)

Risikopositionsklasse nach IRB:
Eigene Schätzungen der LGD bzw. Umrechnungsfaktoren:

RATINGSTUFE (ZEILENKENNUNG)	INTERNES RATINGSYSTEM DER RATINGSTUFE ODER DEM RISIKOPOOL ZUGEWIESENE AUSFALLWAHRSCHEINLICHKEIT (PD) (%)	URSPRÜNGLICHE RISIKOPPOSITION VOR ANWENDUNG VON UMRECHNUNGSEKTOREN		TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG (CRM) MIT SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUF DIE RISIKOPPOSITION			SUBSTITUTION DER RISIKOPPOSITION AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNG	
		DAVON: GROSSE UNTERNEHMEN DER FINANZBRANCHE UND NICHT BEAUFSICHTIGTE FINANZIELLE UNTERNEHMEN	030	(-) GARANTIE	(-) KREDITDERIVATE	(-) ANDERE FORMEN DER BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLIESTUNG	(-) ABFLÜSSE INSGESAMT	ZUFÜSSE INSGESAMT (+)
005	010	020	040	050	060	070	080	

RISIKOPPOSITION NACH SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNGEN VOR DER ANWENDUNG VON UMRECHNUNGSEKTOREN	RISIKOPPOSITIONSWERT			IN SCHÄTZUNGEN DER VERLUSTQUOTE BEI AUSFALL (LGD) BERÜCKSICHTIGTE TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG, OHNE DOPPEL AUSFALLRISIKOBEHANDLUNG			
	DAVON: AUSSERBILANZIELLE POSITIONEN	DAVON: AUSSERBILANZIELLE POSITIONEN	DAVON: GROSSE UNTERNEHMEN DER FINANZBRANCHE UND NICHT BEAUFSICHTIGTE FINANZIELLE UNTERNEHMEN	GARANTIE	KREDITDERIVATE		
090	100	110	120	130	140	150	160

INSCHÄTZUNGEN DER VERLUSTQUOTE BEI AUSEFALL (LGD) BERÜCKSICHTIGTE TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG, OHNE DOPPELAUSFALLRISIKOBEHANDLUNG	BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLISTUNG			DER DOPPELAUSFALLRISIKOBEHANDLUNG UNTERLIEGEND		NACH RISIKOPOSITIONEN GEWICHTETE DURCHSCHNITTLICHE VERLUSTQUOTE BEI AUSEFALL (LGD) (%)
	VERWENDUNG EIGENER LGD-SCHÄTZUNGEN: ANDERE FORMEN DER BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLISTUNG	ANRECHENBARE FINANZIELLE SICHERHEITEN		ABSICHERUNG OHNE SICHERHEITSLISTUNG		
		IMMOBILIEN	SONSTIGE ANRECHENBARE SICHERHEITEN		FORDERUNGEN	
170	180	190	200	210	220	230

NACH RISIKOPOSITIONEN GEWICHTETE DURCHSCHNITTLICHE VERLUSTQUOTE BEI AUSEFALL (LGD) (%) FÜR GROSSE UNTERNEHMEN DER FINANZBRANCHE UND NICHT BEAUFSICHTIGTE FINANZUNTERNEHMEN	NACH RISIKOPOSITIONEN GEWICHTETER DURCHSCHNITTSWERT DER LAUFZEIT (TAGE)	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG VOR ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG NACH ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS		ZUSATZINFORMATIONEN:		
			255	270	ERWARTETER VERLUSTBETRAG	(-) WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN	
							260
240	250	255	260	270	280	290	300

C.09.01 — GEOGRAFISCHE AUFGLIEDERUNG DER RISIKOPOSITIONEN NACH SITZLAND DES SCHULDNERS: SA-RISIKOPOSITIONEN (CR GB 1)

Land:

	URSPRÜNGLICHE RISIKOPOSITION VOR ANWENDUNG VON UMRÉCHNUNGSAKTOREN		Festgestellte neue Ausfälle für den Berichtszeitraum	Allgemeine Kreditrisikoanpassungen	Spezifische Kreditrisikoanpassungen	Abschreibungen	Kreditrisikoanpassungen/Abschreibungen für festgestellte neue Ausfälle	RISIKOPOSITIONSWERT	RISIKOGEWICHTER BETRAG VOR ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS	RISIKOGEWICHTER BETRAG NACH ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS
	010	020								
010	Staaten oder Zentralbanken									
020	Regionale oder lokale Gebietskörperschaften									
030	Öffentliche Stellen									
040	Multilaterale Entwicklungsbanken									
050	Internationale Organisationen									
060	Institute									
070	Unternehmen									
075	davon: KMU									
080	Mengengeschäft									
085	davon: KMU									
090	Durch Hypotheken auf Immobilien besichert									
095	davon: KMU									

	URSPRÜNGLICHE RISIKOPOSITION VOR ANWENDUNG VON UMRECHNUNGSFAKTOREN		Festgestellte neue Ausfälle für den Berichtszeitraum	Allgemeine Kreditrisikoanpassungen	Spezifische Kreditrisikoanpassungen	Abschreibungen	Kreditrisikoanpassungen/Abschreibungen für festgestellte neue Ausfälle	RISIKOPOSITIONSWERT	RISIKOGEWICHTER BETRAG VOR ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS	RISIKOGEWICHTER BETRAG NACH ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS
	010	Ausgefallene Risikopositionen 020								
100				050	055	060	070	075	080	090
	Ausgefallene Positionen									
110										
	Mit besonders hohem Risiko verbundene Positionen									
120										
	Gedekte Schuldverschreibungen									
130										
	Risikopositionen gegenüber Instituten und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung									
140										
	Organismen für Gemeinsame Anlagen (OGA)									
150										
	Beteiligungspositionen									
160										
	Sonstige Risikopositionen									
170										
	Gesamtsumme der Risikopositionen									

C.09.02 — GEOGRAFISCHE AUFGLIEDERUNG DER RISIKOPOSITIONEN NACH SITZLAND DES SCHULDNERS: IRB-RISIKOPOSITIONEN (CR GB 2)

Land:

	URSPRÜNGLICHE RISIKOPOSITION VOR ANWENDUNG VON UMRECHNUNGSFAKTOREN		Festgestellte neue Ausfälle für den Berichtszeitraum	Allgemeine Kreditrisikoanpassungen	Spezifische Kreditrisikoanpassungen	Abschreibungen	Kreditrisikoanpassungen/Abschreibungen für festgestellte neue Ausfälle	DER RATINGSTUFE ODER DEM RISIKOPOOL ZUGEWIESENE AUSFALLWAHRSCHEINLICHKEIT (PD) (%)
	010	Davon: ausgefallen 030						
010	Staaten oder Zentralbanken		040	050	055	060	070	080
020	Institute							
030	Unternehmen							
042	Davon: Spezialfinanzierungen (außer Spezialfinanzierungen, die Zuordnungskriterien unterliegen)							
045	Davon: Spezialfinanzierungen die Zuordnungskriterien unterliegen							
050	Davon: KMU							
060	Mengengeschäft							
070	Durch Immobilien besichert							
080	KMU							
090	Keine KMU							
100	Qualifiziert revolving							
110	Sonstiges Mengengeschäft							
120	KMU							
130	Keine KMU							
140	Beteiligungen							
150	Gesamtsumme der Risikopositionen							

	NACH RISIKOPOSITIONEN GEWICHTETE DURCHSCHNITTLICHE VERLUSTQUOTE BEI AUSEFALL (LGD) (%)		RISIKOPOSITIONS-WERT	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG VOR ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS		RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG NACH ANWENDUNG DES KMU-FAKTORS	ERWARTETER VERLUSTBETRAG
	090	Davon: ausgefallen 100		105	110		
010	Staaten oder Zentralbanken						
020	Institute						
030	Unternehmen						
042	Davon: Spezialfinanzierungen (außer Spezialfinanzierungen, die Zuordnungskriterien unterliegen)						
045	Davon: Spezialfinanzierungen die Zuordnungskriterien unterliegen						
050	Davon: KMU						
060	Mengengeschäft						
070	Durch Immobilien besichert						
080	KMU						
090	Keine KMU						
100	Qualifiziert revolving						
110	Sonstiges Mengengeschäft						
120	KMU						
130	Keine KMU						
140	Beteiligungen						
150	Gesamtsumme der Risikopositionen						

C 09.04 — AUFSCHLÜSSELUNG DER FÜR DIE BERECHNUNG DES ANTIZYKLISCHEN KAPITALPUFFERS NACH LÄNDERN UND DER QUOTE DES INSTITUTTSPEZIFISCHEN ANTIZYKLISCHEN KAPITALPUFFERS WESENTLICHEN KREDITRISIKOPOSITIONEN (CCB)

Land:

	Betrag	Prozentsatz	Qualitative Informationen
	010	020	030
Wesentliche Kreditrisikopositionen — Kreditrisiko			
010			
020			
Wesentliche Kreditrisikopositionen – Marktrisiko			
030			
040			
Wesentliche Kreditrisikopositionen — Verbriefung			
055			
Eigenmittelanforderungen und Gewichungen			
070			
080			
090			
100			
110			
Quoten des antizyklischen Kapitalpuffers			
120			
130			
140			
Anwendung der 2 %-Schwelle			
150			
160			

C 10.02 — KREDITRISIKO: BETEILIGUNGEN — IRB-ANSÄTZE ZUR BESTIMMUNG DER EIGENKAPITALANFORDERUNGEN. AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOBETRÄGE NACH RATINGSTUFEN IM RAHMEN DES PD/LGD-ANSATZES (CR EQU IRB 2)									
RATINGSTUFE (ZEILENKENNUNG)	INTERNES RATINGSYSTEM DER RATINGSTUFE ZU-GEWIESENE AUSFALL-WAHRSCHEINLICHKEIT (PD) (%)	URSPRÜNGLICHE RISIKOPOSITION VOR ANWENDUNG VON UM-RECHNUNGSEKTOREN	TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG (CRM) MIT SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUF DIE RISIKOPOSITION		RISIKOPOSITIONSWERT	NACH RISIKOPOSITIONEN GEWICHTETE DURCHSCHNITTLICHE VERLUSTQUOTE BEI AUSFALL (LGD) (%)	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG	ZUSATZINFORMATION:	
			ABSICHERUNG OHNE SICHERHEITSLISTUNG (-) GARANTIIEN	(-) KREDITDERIVATE				SUBSTITUTION DER RISKOPPOSITION AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNG (-) ABFLÜSSE INSGESAMT	ERWARTETER VERLUSTBETRAG
005	010	020	030	040	050	060	070	080	090



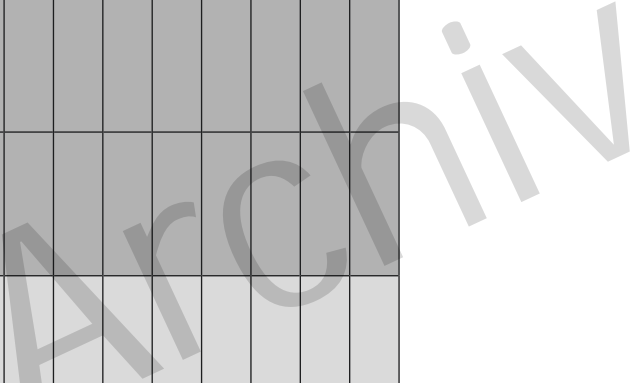
C 11.00 — ABWICKLUNGS- BZW. LIEFERRISIKO (CR SETT)					
	NICHT ABGEWICKELTE GESCHÄFTE ZUM ABRECHNUNGSPREIS 010	RISIKOPOSITION DER AUS NICHT ABGEWICKELTEN GESCHÄFTEN ENTSTEHENDEN PREISDIFFERENZ 020	EIGENMITTELANFORDERUN- GEN 030	GESAMTRISIKOBETRAG FÜR ABWICKLUNGSRISIKEN 040	
010	Summe der nicht abgewickelten Geschäfte im Anlagebuch			Verknüpfung mit CA	
020	Nicht abgewickelte Geschäfte bis zu 4 Tage (Faktor 0 %)				
030	Nicht abgewickelte Geschäfte zwischen 5 und 15 Tagen (Faktor 8 %)				
040	Nicht abgewickelte Geschäfte zwischen 16 und 30 Tagen (Faktor 50 %)				
050	Nicht abgewickelte Geschäfte zwischen 31 und 45 Tagen (Faktor 75 %)				
060	Nicht abgewickelte Geschäfte für 46 Tage oder länger (Faktor 100 %)				
070	Summe der nicht abgewickelten Geschäfte im Handelsbuch			Verknüpfung mit CA	
080	Nicht abgewickelte Geschäfte bis zu 4 Tage (Faktor 0 %)				
090	Nicht abgewickelte Geschäfte zwischen 5 und 15 Tagen (Faktor 8 %)				
100	Nicht abgewickelte Geschäfte zwischen 16 und 30 Tagen (Faktor 50 %)				
110	Nicht abgewickelte Geschäfte zwischen 31 und 45 Tagen (Faktor 75 %)				
120	Nicht abgewickelte Geschäfte für 46 Tage oder länger (Faktor 100 %)				

	GESAMTBETRAG DER DURCH VERBRIEFUNGEN BEGRÜNDETEN RISIKOPOSITIVEN	SYNTHETISCHE VERBRIEFUNGEN: KREDITABSICHERUNG FÜR DIE VERBRIEFTE RISIKOPOSITIVEN			VERBRIEFUNGS-POSITIONEN	(-) WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN	RISIKOPOSITIV ABZÜGLICH WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN
		(-) BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLISTUNG (Cva)	(-) ABFLÜSSE INSGESAMT	NENNWERTE EINBEHALTENER ODER ERWORBENER KREDITABSICHERUNGEN			
	0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070
0140	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0150	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0160	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIVEN						
0170	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0180	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIVEN						
0190	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN						
0200	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIVEN						
0210	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN						
0220	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0230	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIVEN						
0240	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0250	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIVEN						
0260	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0270	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0280	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIVEN						

	GESAMTBETRAG DER DURCH VERBRIEFUNGEN BEGRÜNDETEN RISIKOPOSITIONEN	SYNTHETISCHE VERBRIEFUNGEN: KREDITABSICHERUNG FÜR DIE VERBRIEFTE RISIKOPOSITIONEN			VERBRIEFUNGSPOSITIONEN	(-) WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN	RISIKOPOSITION ABZÜGLICH WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN
		(-) BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLISTUNG (Cva)	(-) ABFLÜSSE INSGESAMT	NENNWERTE EINBEHALTENER ODER ERWORBENER KREDITABSICHERUNGEN			
	0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070
0290	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0300	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0310	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN						
0320	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN						
0330	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN: BALANZWIRKSAME POSTEN						
0340	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0350	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0360	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0370	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0380	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0390	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0400	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0410	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0420	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0430	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN						

	GESAMTBETRAG DER DURCH VERBRIEFUNGEN BEGRÜNDETEN RISIKOPOSITIONEN	SYNTHETISCHE VERBRIEFUNGEN: KREDITABSICHERUNG FÜR DIE VERBRIEFTEN RISIKOPOSITIONEN			VERBRIEFUNGS-POSITIONEN	(-) WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN	RISIKOPOSITION ABZÜGLICH WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN
		(-) BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLISTUNG (Cva)	(-) ABFLÜSSE INSGESAMT	NENNWERTE EINBEHALTENER ODER ERWORBENER KREDITABSICHERUNGEN			
	0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Kurzfristig						
0450	CQS 1						
0460	CQS 2						
0470	CQS 3						
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG						
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Langfristig						
0500	CQS 1						
0510	CQS 2						
0520	CQS 3						
0530	CQS 4						
0540	CQS 5						
0550	CQS 6						
0560	CQS 7						
0570	CQS 8						
0580	CQS 9						

	GESAMTBETRAG DER DURCH VERBRIEFUNGEN BEGRÜNDETEN RISIKOPOSITIVEN	SYNTHETISCHE VERBRIEFUNGEN: KREDITABSICHERUNG FÜR DIE VERBRIEFTEN RISIKOPOSITIVEN				VERBRIEFUNGS-POSITIONEN	(-) WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN	RISIKOPOSITION ABZÜGLICH WERTBERICHTIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN
		(-) BESICHERUNG MIT SICHERHEITSLISTUNG (Cva)	(-) ABFLÜSSE INSGESAMT	(-) ANGEPASSTE WERTE FÜR ABSICHERUNGEN OHNE SICHERHEITSLISTUNG (G*)	NENNWERT EINBEHALTENER ODER ERWORBENER KREDITABSICHERUNGEN			
0590	CQS 10	0020	0030	0040	0050	0060	0070	
0600	CQS 11							
0610	CQS 12							
0620	CQS 13							
0630	CQS 14							
0640	CQS 15							
0650	CQS 16							
0660	CQS 17							
0670	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG							



	TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG (CRM) MIT SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUF DIE RISIKOPOSITION				NETTORISIKOPOSITION NACH SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNGEN VOR DER ANWENDUNG VON UMRECHNUNGSFAKTOREN	(-) TECHNISEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG MIT AUSWIRKUNGEN AUF DEN BETRAG DER RISIKOPOSITION: SICHERHEITSMIT BESICHERUNG MIT UMFASSENDE METHODE ZUR BERÜCKSICHTIGUNG FINANZIELLER SICHERHEITEN, ANGEPAßTER WERT (CVAM)	
	(-) ABSICHERUNG OHNE SICHERHEITSLAISTUNG: ANGEPAßTE WERTE (Ga)		SUBSTITUTION DER RISIKOPOSITION AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNG				
	0080	0090	(-) ABELÜSSE INSGESAMT	ZUFÜSSE INSGESAMT			0100
0010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN						
0020	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN						
0030	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0040	STS-RISIKOPOSITIONEN						
0050	VORRANGIGE POSITION BEI KMU-VERBRIEFUNGEN						
0060	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0070	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN						
0080	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN						
0090	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN						
0100	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0110	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0120	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0130	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						

	TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG (CRM) MIT SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUF DIE RISIKOPOSITION				NETTORISIKO-POSITION NACH SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNGEN VOR DER ANWENDUNG VON UMRECHNUNGSFAKTOREN	(-) TECHNISEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG MIT AUSWIRKUNGEN AUF DEN BETRAG DER RISIKOPOSITION: SICHERHEITSLAISTUNG, UMFASSENDE METHODE ZUR BERÜCKSICHTIGUNG FINANZIELLER SICHERHEITEN, ANGEPAßTER WERT (CVAM)		
	(-) ABSICHERUNG OHNE SICHERHEITSLAISTUNG: ANGEPAßTE WERTE (Ga)		SUBSTITUTION DER RISIKOPOSITION AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNG					
		0080	(-) ABSICHERUNG MIT SICHERHEITSLAISTUNG	(-) ABEFLÜSSE INSGESAMT			ZUFÜSSE INSGESAMT	0110
0140	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0150	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0160	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0170	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0180	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0190	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0200	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0210	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BALANZWIRKSAME POSTEN							
0220	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0230	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0240	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0250	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0260	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0270	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0280	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							

	TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG (CRM) MIT SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUF DIE RISIKOPOSITION				NETTORISIKOPOSITION NACH SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNGEN VOR DER ANWENDUNG VON UMRÉCHNUNGSFAKTOREN	(-) TECHNISEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG MIT AUSWIRKUNGEN AUF DEN BETRAG DER RISIKOPOSITION: SICHERHEITSLAISTUNG, UMFASSENDE METHODE ZUR BERÜCKSICHTIGUNG FINANZIELLER SICHERHEITEN, ANGEPAßTER WERT (CVAM)
	(-) ABSICHERUNG OHNE SICHERHEITSLAISTUNG: ANGEPAßTE WERTE (Ga)		SUBSTITUTION DER RISIKOPOSITION AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNG			
	(-) ABSICHERUNG MIT SICHERHEITSLAISTUNG	(-) ABSICHERUNG INSGESAMT	ZUFÜSSE INSGESAMT	0110		
0080	0090	0100	0110	0120	0130	
0290	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT					
0300	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN					
0310	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN					
0320	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN					
0330	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN					
0340	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT					
0350	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN					
0360	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT					
0370	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN					
0380	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE					
0390	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT					
0400	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN					
0410	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT					
0420	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN					
0430	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN					

	TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG (CRM) MIT SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUF DIE RISIKOPOSITION					NETTORISIKOPOSITION NACH SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNGEN VOR DER ANWENDUNG VON UMRECHNUNGSFAKTOREN	(-) TECHNISEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG MIT AUSWIRKUNGEN AUF DEN BETRAG DER RISIKOPOSITION: SICHERHEITSLAISTUNG, UMFASSENDE METHODE ZUR BERÜCKSICHTIGUNG FINANZIELLER SICHERHEITEN, ANGEPAßTER WERT (CVAM)	
	(-) ABSICHERUNG OHNE SICHERHEITSLAISTUNG: ANGEPAßTE WERTE (Ga)		SUBSTITUTION DER RISIKOPOSITION AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNG		0110			0120
	0080	0090	(-) ABSICHERUNG MIT SICHERHEITSLAISTUNG	(-) ABELÜSSE INSGESAMT				
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Kurzfristig							
0450	CQS 1							
0460	CQS 2							
0470	CQS 3							
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG							
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Langfristig							
0500	CQS 1							
0510	CQS 2							
0520	CQS 3							
0530	CQS 4							
0540	CQS 5							
0550	CQS 6							
0560	CQS 7							
0570	CQS 8							
0580	CQS 9							

	TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG (CRM) MIT SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUF DIE RISIKOPOSITION				NETTORISIKOPOSITION NACH SUBSTITUTIONSEFFEKTEN AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNGEN VOR DER ANWENDUNG VON UMRECHNUNGSFAKTOREN	(-) TECHNIKEN ZUR KREDITRISIKOMINDERUNG MIT AUSWIRKUNGEN AUF DEN BETRAG DER RISIKOPOSITION: SICHERHEITSMETHODEN, UMFASSENDE METHODE ZUR BERÜCKSICHTIGUNG FINANZIELLER SICHERHEITEN, ANGEPAßTER WERT (CVAM)
	(-) ABSICHERUNG OHNE SICHERHEITSLAISTUNG: ANGEPAßTE WERTE (Ga)	(-) ABSICHERUNG MIT SICHERHEITSLAISTUNG	SUBSTITUTION DER RISIKOPOSITION AUFGRUND VON KREDITRISIKOMINDERUNG			
	0080	0090	(-) ABELÜSSE INSGESAMT	ZUFÜSSE INSGESAMT	0120	0130
0590	CQS 10					
0600	CQS 11					
0610	CQS 12					
0620	CQS 13					
0630	CQS 14					
0640	CQS 15					
0650	CQS 16					
0660	CQS 17					
0670	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG					

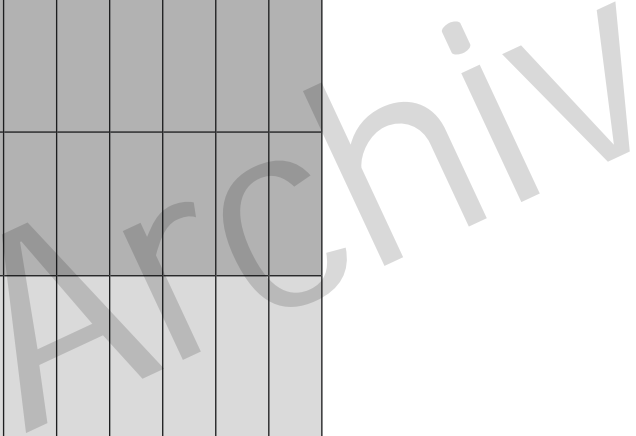
	VOLLSTÄNDIG ANGEPAßTER RISIKOPOSITIONSWERT (E*)	DAVON: MIT EINEM UMRÄHNUNGSAKTOR VON 0%	(-) NICHT ERSTATTUNGSAHIGER KAUPREISABSCHLAG	(-) SPEZIFISCHE KREDITRISIKOANPASSUNGEN BEI ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN	RISIKOPOSITIONSWERT	(-) VON DEN EIGENMITTELN ABGEZOGEN	RISIKOGEWICHTEN UNTERLIEGEND	
								0140
0010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0020	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN							
0030	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0040	STS-RISIKOPOSITIONEN							
0050	VORRANGIGE POSITION BEI KMU-VERBRIEFUNGEN							
0060	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0070	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN							
0080	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0090	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN							
0100	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0110	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0120	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0130	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							

	VOLLSTÄNDIG ANGEPAßTER RISIKOWERT (E*)	DAVON: MIT EINEM UMRÄHNUNGSFAKTOR VON 0%	(-) NICHT ERSTATTUNGSAHIGER KAUFPREISABSCHLAG	(-) SPEZIFISCHE KREDITRISIKOANPASSUNGEN BEI ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN	RISIKOPOSITIONSWERT	(-) VON DEN EIGENMITTELN ABGEZOGEN	RISIKOGEWICHTEN UNTERLIEGEND
0140	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0150	FÜR EINE DIFFERENZIERT EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0160	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0170	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERT EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0180	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0190	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN						
0200	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN						
0210	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN						
0220	FÜR EINE DIFFERENZIERT EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0230	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0240	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERT EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0250	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0260	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0270	FÜR EINE DIFFERENZIERT EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0280	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						

	VOLLSTÄNDIG ANGEPAßTER RISIKOPOSITIONSWERT (E*)	DABON: MIT EINEM UMRÄHNUNGSFAKTOR VON 0%	(-) NICHT ERSTATTUNGSAHIGER KAUFPREISABSCHLAG	(-) SPEZIFISCHE KREDITRISIKOANPASSUNGEN BEI ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN	RISIKOPOSITIONSWERT	(-) VON DEN EIGENMITTELN ABGEZOGEN	RISIKOGEWICHTEN UNTERLIEGEND
0290	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0300	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0310	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN						
0320	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN						
0330	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN						
0340	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0350	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0360	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0370	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0380	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0390	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0400	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0410	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0420	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0430	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN						

	VOLLSTÄNDIG ANGEPAßTER RISIKOPPOSITIONSWERT (E*)	DAVON: MIT EINEM UMRÄHNUNGSAKTOR VON 0%	(-) NICHT ERSTATTUNGSAHIGER KAUPREISABSCHLAG	(-) SPEZIFISCHE KREDITRISIKOANPASSUNGEN BEI ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPPOSITIONEN	RISIKOPPOSITIONSWERT	(-) VON DEN EIGENMITTELN ABGEZOGEN	RISIKOGEWICHTEN UNTERLIEGEND
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Kurzfristig						
0450							
0460							
0470							
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG						
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Langfristig						
0500							
0510							
0520							
0530							
0540							
0550							
0560							
0570							
0580							

	VOLLSTÄNDIG ANGEPAßTER RISIKOPOSITIONSWERT (E*)	DAVON: MIT EINEM UMRÄHNUNGSFAKTOR VON 0%	(-) NICHT ERSTATTUNGSEHIGER KAUPREISABSCHLAG	(-) SPEZIFISCHE KREDITRISIKOANPASSUNGEN BEI ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN	RISIKOPOSITIONSWERT	(-) VON DEN EIGENMITTELN ABGEZOGEN	RISIKOGEWICHTEN UNTERLIEGEND
0590	CQS 10						
0600	CQS 11						
0610	CQS 12						
0620	CQS 13						
0630	CQS 14						
0640	CQS 15						
0650	CQS 16						
0660	CQS 17						
0670	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG						



		AUFSCHÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN					
		SEC-IRBA					
		AUFSCHÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSBÄNDERN					DAVON: NACH ARTIKEL 255 ABSATZ 4 BERECHNET (ANGEKLAUFTE RISIKOPOSITIONEN)
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW	
	0210	0220	0230	0240	0250	0260	0270
0010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN						
0020	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN						
0030	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0040	STS-RISIKOPOSITIONEN						
0050	VORRANGIGE POSITION BEI KMU-VERBRIEFUNGEN						
0060	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0070	WIEDERBRIEFUNGSPPOSITIONEN						
0080	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN						
0090	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN						
0100	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0110	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0120	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0130	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						

		AUFSCHÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						DAVON: NACH ARTIKEL 255 ABSATZ 4 BERECHNET (ANGEKLAUFTE RISIKOPOSITIONEN)
		SEC-IRBA						
		AUFSCHÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSBÄNDERN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW		
	0210	0220	0230	0240	0250	0260	0270	
0140	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0150	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0160	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0170	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0180	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0190	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0200	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0210	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN							
0220	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0230	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0240	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0250	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0260	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0270	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0280	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							

		AUFSCHÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						DAVON: NACH ARTIKEL 255 ABSATZ 4 BERECHNET (ANGEKLAUFTE RISIKOPOSITIO- NEN)
		SEC-IRBA						
		AUFSCHÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSBÄNDERN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW		
		0210	0220	0230	0240	0250	0260	0270
0290	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0300	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0310	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0320	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0330	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN							
0340	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0350	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0360	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0370	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0380	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0390	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0400	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0410	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0420	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0430	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							

		AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						DAVON: NACH ARTIKEL 255 ABSATZ 4 BERECHNET (ANGEKLAUFTE RISIKOPOSITIONEN)
		SEC-IRBA						
		AUFSCHLÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSBÄNDERN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW		
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSTUFEN: Kurzfristig	0210	0220	0230	0240	0250	0260	0270
0450	CQS 1							
0460	CQS 2							
0470	CQS 3							
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTBEURTEILUNG							
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSTUFEN: Langfristig							
0500	CQS 1							
0510	CQS 2							
0520	CQS 3							
0530	CQS 4							
0540	CQS 5							
0550	CQS 6							
0560	CQS 7							
0570	CQS 8							
0580	CQS 9							

		AUFSCHÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						DAVON: NACH ARTIKEL 255 ABSATZ 4 BERECHNET (ANGEKAUFTE RISIKOPOSITIO- NEN)
		SEC-IRBA						
		AUFSCHÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSBÄNDERN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW		
0590	CQS 10	0210	0220	0230	0240	0250	0260	0270
0600	CQS 11							
0610	CQS 12							
0620	CQS 13							
0630	CQS 14							
0640	CQS 15							
0650	CQS 16							
0660	CQS 17							
0670	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG							

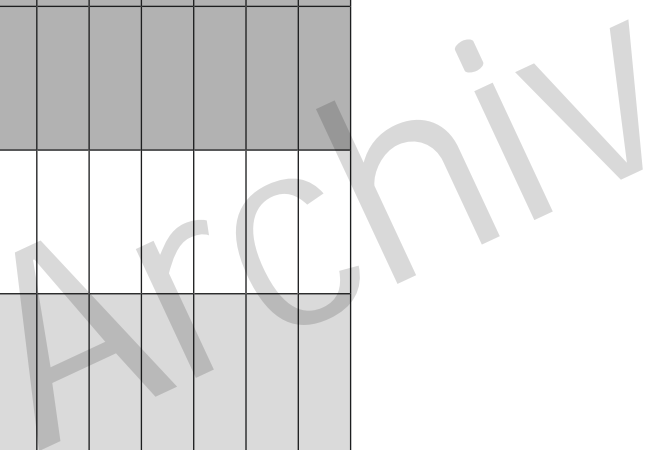
		AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						
		SEC-SA						
		AUFSCHLÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSBÄNDERN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW (W UNBEKANNT)	1 250 % RW (SONSTIGE)	
	0280	0290	0300	0310	0320	0330	0340	
0010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0020	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0030	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0040	STS-RISIKOPOSITIONEN							
0050	VORRANGIGE POSITION BEI KMU-VERBRIEFUNGEN							
0060	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0070	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0080	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0090	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BALANZWIRKSAME POSTEN							
0100	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0110	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0120	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0130	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							

		AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						
		SEC-SA						
		AUFSCHLÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSÄNDEREN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW (W UNBEKANNT)	1 250 % RW (SONSTIGE)	
	0280	0290	0300	0310	0320	0330	0340	
0140	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0150	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0160	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0170	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0180	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0190	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0200	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0210	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN							
0220	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0230	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0240	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0250	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0260	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0270	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0280	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							

		AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						
		SEC-SA						
		AUFSCHLÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSÄNDERN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW (W UNBEKANNT)	1 250 % RW (SONSTIGE)	
	0280	0290	0300	0310	0320	0330	0340	
0290	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0300	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0310	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0320	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0330	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN							
0340	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0350	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0360	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0370	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0380	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0390	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0400	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0410	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0420	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0430	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							

		AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE: NACH RISIKOGEWICHTEN						
		SEC-SA						
		AUFSCHLÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSÄNDEREN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW (W UNBEKANNT)	1 250 % RW (SONSTIGE)	
	0280	0290	0300	0310	0320	0330	0340	
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Kurzfristig							
0450	CQS 1							
0460	CQS 2							
0470	CQS 3							
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG							
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Langfristig							
0500	CQS 1							
0510	CQS 2							
0520	CQS 3							
0530	CQS 4							
0540	CQS 5							
0550	CQS 6							
0560	CQS 7							
0570	CQS 8							
0580	CQS 9							

		SEC-SA						
		AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						
		AUFSCHLÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSÄNDERN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW (W UNBEKANNT)	1 250 % RW (SONSTIGE)	
0280		0290	0300	0310	0320	0330	0340	
0590	CQS 10							
0600	CQS 11							
0610	CQS 12							
0620	CQS 13							
0630	CQS 14							
0640	CQS 15							
0650	CQS 16							
0660	CQS 17							
0670	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG							



AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN												
SEC-ERBA												
AUFSCHLÜSSELUNG NACH BONITÄTSSTUFEN												
LANGFRISTIGE BONITÄTSSTUFEN												
KURZFRISTIGE BONITÄTSSTUFEN												
ALLE SONSTIGEN CQS												
CQS 1	CQS 2	CQS 3	CQS 1	CQS 2	CQS 3	CQS 4	CQS 5	CQS 6	CQS 7			
0360	0370	0380	0390	0400	0410	0420	0430	0440	0450	0460		
0010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN											
0020	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN											
0030	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0040	STS-RISIKOPOSITIONEN											
0050	VORRANGIGE POSITION BEI KMU-VERBRIEFUNGEN											
0060	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0070	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN											
0080	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN											
0090	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BALANZWIRKSAME POSTEN											
0100	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0110	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0120	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0130	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											

AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN													
SEC-ERBA													
AUFSCHLÜSSELUNG NACH BONITÄTSSTUFE													
LANGFRISTIGE BONITÄTSSTUFE													
KURZFRISTIGE BONITÄTSSTUFE													
ALLE SONSTIGEN CQS													
CQS 1	CQS 2	CQS 3	CQS 1	CQS 2	CQS 3	CQS 4	CQS 5	CQS 6	CQS 7				
0360	0370	0380	0390	0400	0410	0420	0430	0440	0450	0460			
0350													
0140	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE												
0150	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT												
0160	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN												
0170	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT												
0180	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN												
0190	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN												
0200	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN												
0210	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN												
0220	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT												
0230	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN												
0240	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT												
0250	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN												
0260	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE												
0270	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT												
0280	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN												

AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN												
SEC-ERBA												
AUFSCHLÜSSELUNG NACH BONITÄTSSTUFEN												
LANGFRISTIGE BONITÄTSSTUFEN												
KURZFRISTIGE BONITÄTSSTUFEN												
ALLE SONSTIGEN CQS												
CQS 1	CQS 2	CQS 3	CQS 3	CQS 3	CQS 1	CQS 2	CQS 3	CQS 4	CQS 5	CQS 6	CQS 7	
0350	0360	0370	0380	0390	0400	0410	0420	0430	0440	0450	0460	
0290	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0300	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0310	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN											
0320	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN											
0330	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN											
0340	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0350	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0360	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0370	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0380	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE											
0390	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0400	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0410	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0420	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0430	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN											

AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN												
SEC-ERBA												
AUFSCHLÜSSELUNG NACH BONITÄTSSSTUFEN												
KURZFRISTIGE BONITÄTSSSTUFEN						LANGFRISTIGE BONITÄTSSSTUFEN						
CQS 1	CQS 2	CQS 3	ALLE SONSTIGEN CQS	CQS 1	CQS 2	CQS 3	CQS 4	CQS 5	CQS 6	CQS 7	CQS 8	CQS 9
0360	0370	0380	0390	0400	0410	0420	0430	0440	0450	0460		
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSSTUFEN: Kurzfristig											
0450	CQS 1											
0460	CQS 2											
0470	CQS 3											
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG											
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSSTUFEN: Langfristig											
0500	CQS 1											
0510	CQS 2											
0520	CQS 3											
0530	CQS 4											
0540	CQS 5											
0550	CQS 6											
0560	CQS 7											
0570	CQS 8											
0580	CQS 9											

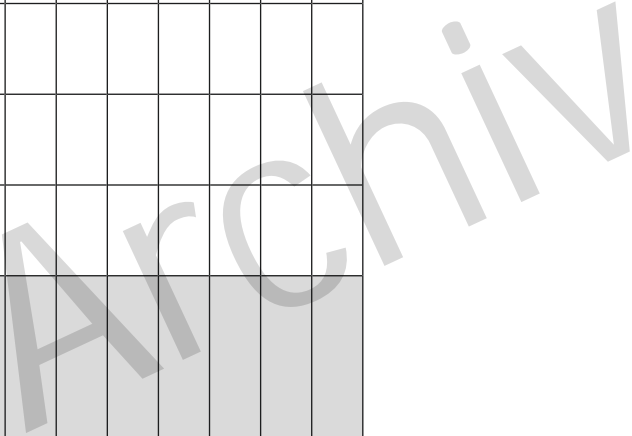
AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN												
SEC-ERBA												
AUFSCHLÜSSELUNG NACH BONITÄTSTUFEN												
LANGFRISTIGE BONITÄTSTUFEN												
	CQS 8	CQS 9	CQS 10	CQS 11	CQS 12	CQS 13	CQS 14	CQS 15	CQS 16	CQS 17	ALLE SONSTIGEN CQS	
	0470	0480	0490	0500	0510	0520	0530	0540	0550	0560	0570	
0010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN											
0020	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN											
0030	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0040	STS-RISIKOPOSITIONEN											
0050	VORRANGIGE POSITION BEI KMU-VERBRIEFUNGEN											
0060	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0070	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN											
0080	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN											
0090	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN											
0100	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0110	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0120	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0130	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											

AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN												
SEC-ERBA												
AUFSCHLÜSSELUNG NACH BONITÄTSTUFEN												
LANGFRISTIGE BONITÄTSTUFEN												
	CQS 8	CQS 9	CQS 10	CQS 11	CQS 12	CQS 13	CQS 14	CQS 15	CQS 16	CQS 17	ALLE SONSTIGEN CQS	
	0470	0480	0490	0500	0510	0520	0530	0540	0550	0560	0570	
0140												
	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE											
0150												
	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0160												
	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0170												
	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0180												
	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0190												
	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN											
0200												
	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN											
0210												
	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN											
0220												
	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0230												
	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0240												
	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0250												
	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0260												
	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE											
0270												
	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0280												
	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											

AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN												
SEC-ERBA												
AUFSCHLÜSSELUNG NACH BONITÄTSTUFEN												
LANGFRISTIGE BONITÄTSTUFEN												
	CQS 8	CQS 9	CQS 10	CQS 11	CQS 12	CQS 13	CQS 14	CQS 15	CQS 16	CQS 17	ALLE SONSTIGEN CQS	
	0470	0480	0490	0500	0510	0520	0530	0540	0550	0560	0570	
0290	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0300	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0310	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN											
0320	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN											
0330	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN											
0340	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0350	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0360	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0370	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0380	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE											
0390	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0400	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0410	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT											
0420	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN											
0430	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN											

AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN												
SEC-ERBA												
AUFSCHLÜSSELUNG NACH BONITÄTSTUFEN												
LANGFRISTIGE BONITÄTSTUFEN												
	CQS 8	CQS 9	CQS 10	CQS 11	CQS 12	CQS 13	CQS 14	CQS 15	CQS 16	CQS 17	ALLE SONSTIGEN CQS	
	0470	0480	0490	0500	0510	0520	0530	0540	0550	0560	0570	
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSTUFEN: Kurzfristig											
0450	CQS 1											
0460	CQS 2											
0470	CQS 3											
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG											
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSTUFEN: Langfristig											
0500	CQS 1											
0510	CQS 2											
0520	CQS 3											
0530	CQS 4											
0540	CQS 5											
0550	CQS 6											
0560	CQS 7											
0570	CQS 8											
0580	CQS 9											

AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN												
SEC-ERBA												
AUFSCHLÜSSELUNG NACH BONITÄTSTUFEN												
LANGFRISTIGE BONITÄTSTUFEN												
	CQS 8	CQS 9	CQS 10	CQS 11	CQS 12	CQS 13	CQS 14	CQS 15	CQS 16	CQS 17	ALLE SONSTIGEN CQS	
	0470	0480	0490	0500	0510	0520	0530	0540	0550	0560	0570	
0590	CQS 10											
0600	CQS 11											
0610	CQS 12											
0620	CQS 13											
0630	CQS 14											
0640	CQS 15											
0650	CQS 16											
0660	CQS 17											
0670	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG											



AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						
SEC-ERBA						
AUFSCHLÜSSELUNG NACH GRÜNDEN FÜR DIE ANWENDUNG VON SEC-ERBA						
	DARLEHEN FÜR KFZ-KÄUFE, LEASING VON KFZ UND AUSRÜSTUNGSGEGENSTÄNDEN	OPTION SEC-ERBA	POSITIONEN, DIE UNTER ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE a CRR FALLEN	POSITIONEN, DIE UNTER ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE b CRR FALLEN	ARTIKEL 254 ABSATZ 4 ODER ARTIKEL 258 ABSATZ 2 DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EINHALTUNG DER RANGFOLGE DER ANSÄTZE
	0580	0590	0600	0610	0620	0630
0010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN					
0020	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN					
0030	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT					
0040	STS-RISIKOPOSITIONEN					
0050	VORRANGIGE POSITION BEI KMU-VERBRIEFUNGEN					
0060	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT					
0070	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN					
0080	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN					
0090	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN					
0100	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT					
0110	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN					
0120	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT					
0130	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN					

AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						
SEC-ERBA						
AUFSCHLÜSSELUNG NACH GRÜNDEN FÜR DIE ANWENDUNG VON SEC-ERBA						
DARLEHEN FÜR KFZ-KÄUFE, LEASING VON KFZ UND AUSRÜSTUNGSGEGENSTÄNDEN	OPTION SEC-ERBA	POSITIONEN, DIE UNTER ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE a CRR FALLEN	POSITIONEN, DIE UNTER ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE b CRR FALLEN	ARTIKEL 254 ABSATZ 4 ODER ARTIKEL 258 ABSATZ 2 DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EINHALTUNG DER RANGFOLGE DER ANSÄTZE	
0580	0590	0600	0610	0620	0630	
0140						
VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0150						
FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0160						
DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0170						
NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0180						
DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0190						
WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN						
0200						
ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN						
0210						
VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN						
0220						
FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0230						
DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0240						
NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0250						
DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0260						
VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0270						
FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0280						
DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						

AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						
SEC-ERBA						
AUFSCHLÜSSELUNG NACH GRÜNDEN FÜR DIE ANWENDUNG VON SEC-ERBA						
DARLEHEN FÜR KFZ-KÄUFE, LEASING VON KFZ UND AUSRÜSTUNGSGEGENSTÄNDEN	OPTION SEC-ERBA	POSITIONEN, DIE UNTER ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE a CRR FALLEN	POSITIONEN, DIE UNTER ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE b CRR FALLEN	ARTIKEL 254 ABSATZ 4 ODER ARTIKEL 258 ABSATZ 2 DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EINHALTUNG DER RANGFOLGE DER ANSÄTZE	
0580	0590	0600	0610	0620	0630	
0290						
0300						
0310						
0320						
0330						
0340						
0350						
0360						
0370						
0380						
0390						
0400						
0410						
0420						
0430						

AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						
SEC-ERBA						
AUFSCHLÜSSELUNG NACH GRÜNDEN FÜR DIE ANWENDUNG VON SEC-ERBA						
DARLEHEN FÜR KFZ-KÄUFE, LEASING VON KFZ UND AUSRÜSTUNGSGEGENSTÄNDEN	OPTION SEC-ERBA	POSITIONEN, DIE UNTER ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE a CRR FALLEN	POSITIONEN, DIE UNTER ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE b CRR FALLEN	ARTIKEL 254 ABSATZ 4 ODER ARTIKEL 258 ABSATZ 2 DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EINHALTUNG DER RANGFOLGE DER ANSÄTZE	
0580	0590	0600	0610	0620	0630	
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Kurzfristig					
0450	CQS 1					
0460	CQS 2					
0470	CQS 3					
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG					
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Langfristig					
0500	CQS 1					
0510	CQS 2					
0520	CQS 3					
0530	CQS 4					
0540	CQS 5					
0550	CQS 6					
0560	CQS 7					
0570	CQS 8					
0580	CQS 9					

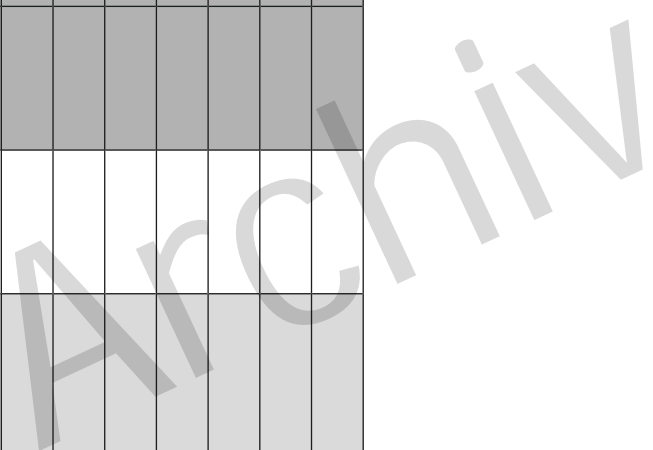
AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						
SEC-ERBA						
AUFSCHLÜSSELUNG NACH GRÜNDEN FÜR DIE ANWENDUNG VON SEC-ERBA						
	DARLEHEN FÜR KFZ-KÄUFE, LEASING VON KFZ UND AUS- RÜSTUNGSGEGEN- STÄNDEN	OPTION SEC-ERBA	POSITIONEN, DIE UNTER ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE a CRR FALLEN	POSITIONEN, DIE UNTER ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE b CRR FALLEN	ARTIKEL 254 ABSATZ 4 ODER ARTIKEL 258 ABSATZ 2 DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EINHALTUNG DER RANGFOLGE DER ANSÄTZE
	0580	0590	0600	0610	0620	0630
0590	CQS 10					
0600	CQS 11					
0610	CQS 12					
0620	CQS 13					
0630	CQS 14					
0640	CQS 15					
0650	CQS 16					
0660	CQS 17					
0670	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG					

		AUFSCHÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						SONSTIGE (RW = 1 250 %)
		INTERNER BEMESSUNGSANSATZ						
		AUFSCHÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSÄNDEREN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW		
		0640	0650	0660	0670	0680	0690	0700
0140	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0150	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0160	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0170	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0180	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0190	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0200	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0210	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN							
0220	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0230	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0240	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0250	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0260	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0270	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0280	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							

		AUFSCHÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN						SONSTIGE (RW = 1 250 %)
		INTERNER BEMESSUNGSANSATZ						
		AUFSCHÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSÄNDERN						
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW		
		0640					0690	0700
0290	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0300	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0310	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN							
0320	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0330	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN							
0340	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0350	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0360	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0370	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0380	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0390	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0400	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0410	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0420	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0430	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN							

		AUFSCHLÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE: NACH RISIKOGEWICHTEN							SONSTIGE (RW = 1 250 %)
		INTERNER BEMESSUNGSANSATZ							
		AUFSCHLÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSÄNDEREN							
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW			
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSTUFEN: Kurzfristig	0640						0700	
0450	CQS 1								
0460	CQS 2								
0470	CQS 3								
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG								
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSTUFEN: Langfristig								
0500	CQS 1								
0510	CQS 2								
0520	CQS 3								
0530	CQS 4								
0540	CQS 5								
0550	CQS 6								
0560	CQS 7								
0570	CQS 8								
0580	CQS 9								

		AUFSCHÜSSELUNG DER RISIKOPOSITIONSWERTE NACH RISIKOGEWICHTEN							SONSTIGE (RW = 1 250 %)
		INTERNER BEMESSUNGSANSATZ							
		AUFSCHÜSSELUNG NACH RISIKOGEWICHTSÄNDEREN							
		= < 20 % RW	> 20 % BIS 50 % RW	> 50 % BIS 100 % RW	> 100 % BIS < 1 250 % RW	1 250 % RW			
0590	CQS 10	0650	0660	0670	0680	0690	0700		
0600	CQS 11								
0610	CQS 12								
0620	CQS 13								
0630	CQS 14								
0640	CQS 15								
0650	CQS 16								
0660	CQS 17								
0670	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG								



	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG							
	SEC-IRBA				SEC-SA		SEC-ERBA	
	0710	0720	0730	0740	0750	0760	0770	0780
0010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0020	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0030	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0040	STS-RISIKOPOSITIONEN							
0050	VORRANGIGE POSITION BEI KMU-VERBRIEFUNGEN							
0060	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0070	WIEDERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0080	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0090	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN							
0100	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0110	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0120	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0130	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							

RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG															
	SEC-IRBA				SEC-SA		SEC-ERBA								
		DAVON: NACH ARTIKEL 255 ABSATZ 4 BERECHNET (ANGEKAUFTE RISIKOPOSITIO- NEN)	0720	0730		DAVON: RW = 1 250 % (W UNBEKANNT)	0740	0750	0760	DARLEHEN FÜR KFZ-KÄUFE, LEASING VON KFZ UND AUSRÜS- TUNGS- GEGEN- STANDEN	0770	OPTION SEC- ERBA	0780	ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE A DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	0790
0140	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE														
0150	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT														
0160	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN														
0170	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT														
0180	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN														
0190	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN														
0200	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN														
0210	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN														
0220	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT														
0230	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN														
0240	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT														
0250	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN														
0260	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE														
0270	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT														
0280	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN														

	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG							
	SEC-IRBA				SEC-SA		SEC-ERBA	
	0710	0720	0730	0740	0750	0760	0770	0780
0290	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0300	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0310	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0320	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0330	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN							
0340	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0350	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0360	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0370	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0380	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE							
0390	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0400	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0410	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0420	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0430	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							

RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG												
	SEC-IRBA				SEC-SA		SEC-ERBA					
	0710	0720	0730	0740	0750	0760	0770	0780	0790			
	DAVON: NACH ARTIKEL 255 / ABSATZ 4 BERECHNET (ANGEKAUFTE RISIKOPOSITIONEN)									DARLEHEN FÜR KFZ-KÄUFE, LEASING VON KFZ UND AUSRÜSTUNGS- GEGEN- STANDEN	OPTION SEC- ERBA	ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE A DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Kurzfristig											
0450	CQS 1											
0460	CQS 2											
0470	CQS 3											
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG											
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Langfristig											
0500	CQS 1											
0510	CQS 2											
0520	CQS 3											
0530	CQS 4											
0540	CQS 5											
0550	CQS 6											
0560	CQS 7											
0570	CQS 8											
0580	CQS 9											

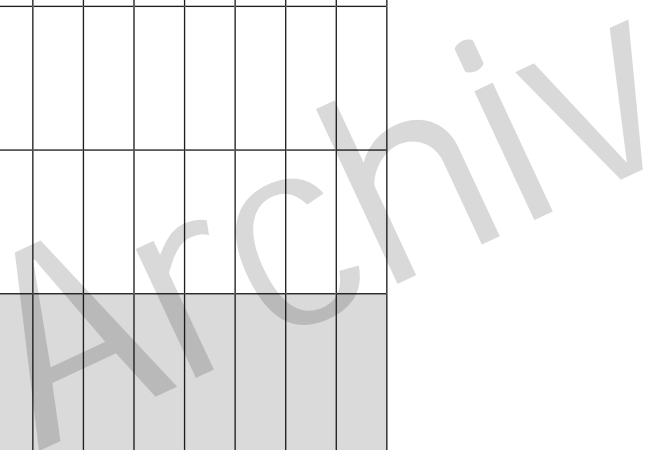
		RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG						
		SEC-ERBA		INTERNER BEMESSUNGSANSATZ		SONSTIGE (RW = 1 250 %)	DAVON: SYNTHETISCHE VERBRIEFUNGEN	
		ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE B DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	ARTIKEL 254 ABSATZ 4 ODER ARTIKEL 258 ABSATZ 2 DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EINHALTUNG DER RANGFOLGE DER ANSÄTZE	DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)			
		0800	0810	0820	0830	0840	0850	
0010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							0860
0020	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0030	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0040	STS-RISIKOPOSITIONEN							
0050	VORRANGIGE POSITION BEI KMU-VERBRIEFUNGEN							
0060	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0070	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN							
0080	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN							
0090	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN							
0100	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0110	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							
0120	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT							
0130	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN							

	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG						
	SEC-ERBA		INTERNER BEMESSUNGSANSATZ			SONSTIGE (RW = 1 250 %)	
	ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE B DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	ARTIKEL 254 ABSATZ 4 ODER ARTIKEL 258 ABSATZ 2 DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EINHALTUNG DER RANGFOLGE DER ANSÄTZE	DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)			DAVON: SYNTHETISCHE VERBRIEFUNGEN
	0800	0810	0820	0830	0840	0850	0860
0140	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0150	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0160	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0170	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0180	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0190	WIEDERVERBRIEFUNGSPPOSITIONEN						
0200	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN						
0210	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: BALANZWIRKSAME POSTEN						
0220	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0230	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0240	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0250	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0260	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0270	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0280	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						

		RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG					
		SEC-ERBA		INTERNER BEMESSUNGSANSATZ		SONSTIGE (RW = 1 250 %)	
		ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE B DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	ARTIKEL 254 ABSATZ 4 ODER ARTIKEL 258 ABSATZ 2 DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EINHALTUNG DER RANGFOLGE DER ANSÄTZE	DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)		
		0800	0810	0820	0830	0840	0850
		DAVON: SYNTHETISCHE VERBRIEFUNGEN					
		0860					
0290	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0300	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0310	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN						
0320	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN						
0330	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN: BILANZWIRKSAME POSTEN						
0340	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0350	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0360	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0370	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0380	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
0390	FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0400	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0410	NICHT FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT						
0420	DAVON: VORRANGIGE RISIKOPOSITIONEN						
0430	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN						

		RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG						
		SEC-ERBA		INTERNER BEMESSUNGSANSATZ		SONSTIGE (RW = 1 250 %)	DAVON: SYNTHETISCHE VERBRIEFUNGEN	
		ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE B DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	ARTIKEL 254 ABSATZ 4 ODER ARTIKEL 258 ABSATZ 2 DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EINHALTUNG DER RANGFOLGE DER ANSÄTZE	DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)			
		0800	0810	0820	0830	0840	0850	
0440	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Kurzfristig							0860
0450	CQS 1							
0460	CQS 2							
0470	CQS 3							
0480	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG							
0490	AUFSCHLÜSSELUNG AUSSTEHENDER POSITIONEN NACH DEN BEI GESCHÄFTSABSCHLUSS ANGEWENDETEN BONITÄTSSTUFEN: Langfristig							
0500	CQS 1							
0510	CQS 2							
0520	CQS 3							
0530	CQS 4							
0540	CQS 5							
0550	CQS 6							
0560	CQS 7							
0570	CQS 8							
0580	CQS 9							

		RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG						
		SEC-ERBA		INTERNER BEMESSUNGSANSATZ		SONSTIGE (RW = 1 250 %)	DAVON: SYNTHETISCHE VERBRIEFUNGEN	
		ARTIKEL 254 ABSATZ 2 BUCHSTABE B DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	ARTIKEL 254 ABSATZ 4 ODER ARTIKEL 258 ABSATZ 2 DER CRR UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EINHALTUNG DER RANGFOLGE DER ANSÄTZE	DURCHSCHNITTLICHES RISIKOGEWICHT (%)			
		0800	0810	0820	0830	0840	0850	
0590	CQS 10							0860
0600	CQS 11							
0610	CQS 12							
0620	CQS 13							
0630	CQS 14							
0640	CQS 15							
0650	CQS 16							
0660	CQS 17							
0670	ALLE SONSTIGEN CQS UND OHNE BONITÄTSBEURTEILUNG							



C 14.00 — DETAILLIERTE ANGABEN ZU VERBRIEFUNGEN (SEC Details)

ZEILEN- NUMMER	INTERNER CODE	KENNUNG DER VERBRIEFUNG	GRUPPENINTERNE, PRIVATE ODER ÖFFENTLICHE VERBRIEFUNG?	FUNKTION DES INSTITUTS/ (ORIGINATOR / SPONSOR / URSPRÜNGLICHER KREDITGEBER / ANLEGER)	KENNUNG DES ORIGINATORS	VERBRIEFUNGSART: (TRADITIONELL / SYNTHETISCH / ABCP- PROGRAMM / ABCP- TRANSAKTION)	BILANZIERUNGS- METHODE: WERDEN VERBRIEFTE RISIKO- POSITIONEN IN DER BILANZ BEHALTEN ODER AUS IHR ENT- FERNT?	SOLVENZRECHT- LICHE BEHAND- LUNG: Unterliegen die Verbriefungsposi- tionen Eigenmittel- anforderungen?	ÜBERTRAGUNG EINES SIGNIFIKANTEN RISIKOS	VERBRIEFUNG ODER WIEDER- VERBRIEFUNG?	STS- ODER NICHT-STS- VERBRIEFUNG?	FÜR EINE DIF- FERENZIERTE EIGENMITTEL- BEHANDLUNG QUALIFIZIERTE VERBRIEFUNG?
005	010	020	021	110	030	040	051	060	061	070	075	446

ART DES AN- GEWENDETEN SELBSTBE- HALTS	SELBSTBEHALT			NICHT ABCP-PROGRAMME			VERBRIEFTE RISIKOPOSITIONEN									
	% DES SELBST- BEHALTS AM BE- RICHTSSTICHTAG	EINHALTUNG DER SELBSTBEHALTAN- FORDERUNG?	URSPRUNGS- DATUM (MM/JJJJ)	DATUM DER LETZTEN BEBERUNG (MM/JJJJ)	GESAMTSUMME DER VERBRIEFTEN RISIKOPOSITIO- NEN AM ORIGINIE- RUNGSdatum	GESAMTBE- TRAG	ANTEIL DES INSTITUTS (%)	TYP	PROZENTUA- LER ANTEIL DES IRB-ANSAT- ZES AN DEN GENUTZTEN ANSÄTZEN	ANZAHL DER RISIKOPOSITIO- NEN	AUSGEFALLENE RISIKOPOSITIO- NEN W (%)	LAND	LGD (%)	EL %	UL %	
080	090	100	120	121	130	140	150	160	171	180	181	190	201	202	203	

RISIKOPOSITIONS- GEWICHTER DURCHSCHNITT DER LAUFZEIT VON VERMÖGENS- WERTEN	VERBRIEFTE RISIKOPOSITIONEN						VERBRIEFUNGSSTRUKTUR									
	EIGENMITTELAN- FORDERUNGEN VOR VERBRIE- FUNG (%) K _{1b}			PROZENTUA- LER ANTEIL DER MENGEN- GESCHÄFTSRI- SIKOPOSITIO- NEN IN IRB-POOLS			ZUSATZINFORMA- TIONEN			BILANZWIRKSAME POSTEN			ERSTVERLUST			
	(+) WERTBERICH- TIGUNGEN UND RÜCKSTELLUNGEN	EIGENMITTELAN- FORDERUNGEN VOR VERBRIE- FUNG (%) K _{1b}	URSPRUNGS- DATUM (MM/JJJJ)	DATUM DER LETZTEN BEBERUNG (MM/JJJJ)	GESAMTSUMME DER VERBRIEFTEN RISIKOPOSITIO- NEN AM ORIGINIE- RUNGSdatum	GESAMTBE- TRAG	ANTEIL DES INSTITUTS (%)	TYP	PROZENTUA- LER ANTEIL DES IRB-ANSAT- ZES AN DEN GENUTZTEN ANSÄTZEN	ANZAHL DER RISIKOPOSITIO- NEN	AUSGEFALLENE RISIKOPOSITIO- NEN W (%)	LAND	LGD (%)	EL %	UL %	
204	210	221	222	223	225	230	231	232	240	241	242	250	251	252		

VORRANGIG	VERBRIEFUNGSSTRUKTUR						ZUSATZINFORMATIONEN		
	LAUFZEIT			IM GESCHÄFT ENTHALTENE KAUFOPTIONEN DES ORIGINATORS			UNTERER TRANCHIERUNGSPUNKT DES VERÄUSSERTEN RISIKOS (%)	OBERER TRANCHIERUNGSPUNKT DES VERÄUSSERTEN RISIKOS (%)	VOM ORIGINIERENDEN INSTITUT ANGEBEBENER RISIKOTRANSFER (%)
260	270	280	290	291	300	302	303	304	

C 14.01 — DETAILLIERTE ANGABEN ZU VERBRIEFUNGEN NACH ANSATZ (Ansatz SEC Details)

Ansatz:

ZEILENNUMMER	INTERNER CODE	KENNUNG DER VERBRIEFUNG	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN											
			URSPRÜNGLICHE RISIKOPOSITION VOR ANWENDUNG VON UMRÉCHNUNGSAKTOREN					AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE						
			BILANZWIRKSAME POSTEN		VORRANGIG			MEZZANINE			ERSTVERLUST		RISIKOGEWICHT SICHERUNGSGEBER / INSTRUMENT	
			VORRANGIG	MEZZANINE	ERSTVERLUST	VORRANGIG	MEZZANINE	ERSTVERLUST	RISIKOGEWICHT SICHERUNGSGEBER / INSTRUMENT	MEZZANINE	RISIKOGEWICHT SICHERUNGSGEBER / INSTRUMENT	ERSTVERLUST	RISIKOGEWICHT SICHERUNGSGEBER / INSTRUMENT	
005	010	020	310	320	330	340	350	351	360	361				

VERBRIEFUNGSPOSITIONEN	ZUSATZINFORMATIONEN: AUSSERBILANZIELLE POSTEN UND DERIVATE VOR DER ANWENDUNG VON UMRÉCHNUNGSAKTOREN		RISIKOPOSITIONSWERT	(-) VON DEN EIGENMITTELN ABGEZOGENER RISIKOPOSITIONSWERT	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG INSGESAMT			ZUSATZINFORMATIONEN		VERBRIEFUNGSPOSITIONEN – HANDELSBUCH				
	IRS / CRS	LIQUIDITÄTSFAZILITÄTEN			SONSTIGE	VOR ANWENDUNG DER OBERGRENZE	(-) HERABSETZUNG AUFGRUND VON RISIKOGEWICHTS-BEGRENZUNG	(+/-) HERABSETZUNG AUFGRUND VON ALLGEMEINER BEGRENZUNG	NACH OBERGRENZE	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG BEIM SEC-ERBA	RISIKOGEWICHTETER POSITIONSBETRAG BEIM SEC-SANSAITZ	CTP ODER NICHT-CTP?	NETTOPOSITIONEN	
														KAUFPOSITION
370	380	390	400	411	420	430	431	432	440	447	448	450	460	470

C 16.00 — OPERATIONELLES RISIKO (OPR)									
BANKTÄTIGKEITEN									
	MASSEBLICHER INDIKATOR			DARLEHEN UND KREDITE (BEI ANWENDUNG DES ASA)			EIGENMITTELAN- FORDERUNG	Gesamtbeitrag der Risikoexposition operationelles Risiko	
	JAHR-3 010	JAHR-2 020	LETZTES JAHR 030	JAHR-3 040	JAHR-2 050	LETZTES JAHR 060			
010	1. DEM BASISINDIKATORANSATZ (BIA) UNTERLIEGENDE BANKTÄTIGKEITEN								
020	2. DEM STANDARDANSATZ (SA) BZW. DEM ALTERNATIVEN STANDARDANSATZ (ASA) UNTERLIEGENDE BANKTÄTIGKEITEN								
	DEM SA UNTERLIEGEND:								
030	UNTERNEHMENSFINANZIERUNG/-BERATUNG (CF)								
040	HANDEL (TRADING AND SALES) (TS)								
050	WERTPAPIERPROVISIONSGESCHÄFT (RBtr)								
060	FIRMENKUNDENGESCHÄFT (CB)								
070	PRIVATKUNDENGESCHÄFT (RB)								
080	ZAHLUNGSVERKEHR UND VERRECHNUNG (PS)								
090	DEPOT UND TREUHANDGESCHÄFTE (AS)								
100	VERMÖGENSVERWALTUNG (AM)								
	DEM ASA UNTERLIEGEND:								
110	FIRMENKUNDENGESCHÄFT (CB)								
120	PRIVATKUNDENGESCHÄFT (RB)								
130	3. FORTGESCHRITTENEN MESSANSÄTZEN UNTERLIEGENDE BANKTÄTIGKEITEN — AMA								
							070	071	
								Verknüpfung mit CA2	
								Verknüpfung mit CA2	
								Verknüpfung mit CA2	

	GEBEENEFALLS AUSZUWEISENDE ZUSATZINFORMATIONEN NACH AMA				(-) REDUKTION DER EIGENMITTELANFORDERUNG AUFGRUND VON TECHNIKEN ZUR RISIKOMINDERUNG (VERSICHERUNGSSCHUTZ UND SONSTIGE RISIKOÜBERTRAGUNGSMECHANISMEN)
	DAVON: AUF EINEN ALLOKATIONSMECHANISMUS ZURÜCKZUFÜHREN	EIGENMITTELANFORDERUNG VOR ENTLASTUNGSEFFEKTEN AUFGRUND VON ERWARTETEN VERLUSTEN, DIVERSIFIZIERUNG UND RISIKOMINDERUNGSTECHNIKEN	(-) REDUKTION DER EIGENMITTELANFORDERUNG AUFGRUND DES IN DER GESCHÄFTSPRAKTIS ERFASSTEN, ERWARTETEN VERLUSTS	(-) REDUKTION DER EIGENMITTELANFORDERUNG AUFGRUND VON DIVERSIFIZIERUNGEN	
BANKTÄTIGKEITEN	080	090	100	110	120
010					
1. DEM BASISINDIKATORANSATZ (BIA) UNTERLIEGENDE BANKTÄTIGKEITEN					
020					
2. DEM STANDARDANSATZ (SA) BZW. DEM ALTERNATIVEN STANDARDANSATZ (ASA) UNTERLIEGENDE BANKTÄTIGKEITEN					
DEM SA UNTERLIEGEND:					
030					
UNTERNEHMENSFINANZIERUNG/-BERATUNG (CF)					
040					
HANDEL (TRADING AND SALES) (TS)					
050					
WERTPAPIERPROVISIONSGESCHÄFT (Rbf)					
060					
FIRMENKUNDENGESCHÄFT (CB)					
070					
PRIVATKUNDENGESCHÄFT (RB)					
080					
ZAHLUNGSVERKEHR UND VERRECHNUNG (PS)					
090					
DEPOT UND TREUHANDGESCHÄFTE (AS)					
100					
VERMÖGENSVERWALTUNG (AM)					
DEM ASA UNTERLIEGEND:					
110					
FIRMENKUNDENGESCHÄFT (CB)					
120					
PRIVATKUNDENGESCHÄFT (RB)					
130					
3. FORTGESCHRITTENEN MESSANSÄTZEN UNTERLIEGENDE BANKTÄTIGKEITEN — AMA					

ZUSATZINFORMATION: BEI DER DATENSAMMLUNG ANGEWANDTE BAGATELLENZEHRE	VERLUST- EREIGNIS- KATEGORIEN INSGESAMT		VERLUSTEREIGNISKATEGORIEN								
	NIEDRIGS- TE/R	HÖCHSTE/R	0080	0070	0060	0050	0040	0030	0020	0010	
											AUSFÜHRUNG, LIEFERUNG UND PROZESS- MANAGEMENT
	0090	0100	0080	0070	0060	0050	0040	0030	0020	0010	
ZUORDNUNG VON VERLUSTEN ZU GESCHÄFTSFELDERN											
0210											Anzahl der Verlustereignisse (neue Verlustereignisse)
0220											Bruttoverlustbetrag (neue Verlustereignisse)
0230											Anzahl der Verlustereignisse mit Verlustanpassung
0240											Verlustanpassungen für frühere Berichtsperioden
0250											Größter Einzelverlust
0260											Summe der fünf größten Verluste
0270											Direkter Gesamtrückfluss von Verlusten
0280											Gesamtrückfluss aus Versicherungsschutz und sonstigen Risikübertragungsmechanismen

ZUSATZINFORMATION: BEI DER DATENSAMMLUNG ANGEWANDTE BAGATELLENZWE	VERLUST- EREIGNIS- KATEGORIEN INSGESAMT		VERLUSTEREIGNISKATEGORIEN								
	NIEDRIG- STE/R	HÖCHSTE/R	0080	0070	0060	0050	0040	0030	0020	0010	
											AUSFÜHRUNG, LIEFERUNG UND PROZESS- MANAGEMENT
	0090	0100	0080	0070	0060	0050	0040	0030	0020	0010	
ZUORDNUNG VON VERLUSTEN ZU GESCHÄFTSFELDERN											
0410										Anzahl der Verlustereignisse (neue Verlustereignisse)	
0420										Bruttoverlustbetrag (neue Verlustereignisse)	
0430										Anzahl der Verlustereignisse mit Verlustanpassung	
0440										Verlustanpassungen für frühere Berichtsperioden	
0450										Größter Einzelverlust	
0460										Summe der fünf größten Verluste	
0470										Direkter Gesamtrückfluss von Verlusten	
0480										Gesamtrückfluss aus Versicherungsschutz und sonstigen Risikübertragungsmechanismen	

ZUORDNUNG VON VERLUSTEN ZU GESCHÄFTSFELDERN	VERLUSTEREIGNISKATEGORIEN								VERLUSTEREIGNISKATEGORIEN INSGESAMT	ZUSATZINFORMATION: BEI DER DATENSAMMLUNG ANGEWANDTE BAGATELLENRENZE	
	INTERNER BETRUG	EXTERNER BETRUG	BESCHÄFTIGUNGSPRAXIS UND ARBEITSSICHERHEIT	KUNDEN, PRODUKTE UND GESCHÄFTSGEPFLOGENHEITEN	SACHSCHÄDEN	GESCHÄFTS-UNTERBRECHUNG UND SYSTEMAUSFÄLLE	AUSFÜHRUNG, LIEFERUNG UND PROZESS-MANAGEMENT	NIEDRIGSTE/HÖCHSTE/R			
	0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0090		0100	
Zeilen											
0610	Anzahl der Verlustereignisse (neue Verlustereignisse)										
0620	Bruttoverlustbetrag (neue Verlustereignisse)										
0630	Anzahl der Verlustereignisse mit Verlustanpassung										
0640	Verlustanpassungen für frühere Berichtsperioden										
0650	Größter Einzelverlust										
0660	Summe der fünf größten Verluste										
0670	Direkter Gesamtrückfluss von Verlusten										
0680	Gesamtrückfluss aus Versicherungsschutz und sonstigen Risikoubertragungsmechanismen										

ZUSATZINFORMATION: BEI DER DATENSAMMLUNG ANGEWANDTE BAGATELLENZWE	VERLUST- EREIGNIS- KATEGORIEN INSGESAMT		VERLUSTEREIGNISKATEGORIEN								
	NIEDRIG- STE/R	HÖCHSTE/R	0090	0100	0070	0060	0050	0040	0030	0020	0010
	ZUORDNUNG VON VERLUSTEN ZU GESCHÄFTSFELDERN										
0810	Anzahl der Verlustereignisse (neue Verlustereignisse)										
0820	Bruttoverlustbetrag (neue Verlustereignisse)										
0830	Anzahl der Verlustereignisse mit Verlustanpassung										
0840	Verlustanpassungen für frühere Berichtsperioden										
0850	Größter Einzelverlust										
0860	Summe der fünf größten Verluste										
0870	Direkter Gesamtrückfluss von Verlusten										
0880	Gesamtrückfluss aus Versicherungsschutz und sonstigen Risikübertragungsmechanismen										
UNTERNEHMENSPOSTEN [CI]											
Zeilen											

C 17.02 — OPERATIONELLES RISIKO: GROSSE VERLUSTEREIGNISSE (OPR DETAILS 2)

ID des Ereignisses	Erfassungzeitpunkt	Eintrittszeitpunkt	Erkennungzeitpunkt	Verlustereigniskategorie	Bruttoverluste	Bruttoverluste abzüglich direkter Rückflüsse	BRUTTOVERLUSTENACH GESCHÄFTSFELDERN										Name des Rechtsträgers	ID des Rechtsträgers	Geschäftsbereich	Beschreibung
							Unternehmensfinanzierung/-beratung [CF]	Handel (Trading and Sales) [TS]	Wertpapierprovisionsgeschäft [RB]	Firmenkundengeschäft [CB]	Privatkundengeschäft [RB]	Zahlungsverkehr und Verrechnung [PS]	Depot- und Treuhandgeschäfte [AS]	Vermögensverwaltung [AM]	Unternehmenstypen [CI]					
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200	
Zeilen																				
...																				



C 18.00 — MARKTRISIKO: STANDARDANSATZ FÜR POSITIONSRISIKEN BÖRSENGEHANDELTEN SCHULDTITEL (MKR SA TDI)

Währung:

	POSITIONEN					EIGENMITTELANFORDERUNGEN	GESAMTRISIKOBETRAG
	ALLE POSITIONEN		NETTOPOSITIONEN		EINER KAPITALANFORDERUNG UNTERLIEGENDE POSITIONEN		
	KAUFPOSITION	VERKAUFPOSITION	KAUFPOSITION	VERKAUFPOSITION			
010	020	030	040	050	060	070	
010	BÖRSENGEHANDELTE SCHULDTITEL IM HANDELSBUCH						Verknüpfung mit CA2
011	Allgemeines Risiko						
012	Derivate						
013	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten						
020	Laufzeitbezogener Ansatz						
030	Bereich 1						
040	0 ≤ 1 Monat						
050	> 1 ≤ 3 Monate						
060	> 3 ≤ 6 Monate						
070	> 6 ≤ 12 Monate						
080	Bereich 2						
090	> 1 ≤ 2 (1,9 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre						
100	> 2 ≤ 3 (> 1,9 ≤ 2,8 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre						
110	> 3 ≤ 4 (> 2,8 ≤ 3,6 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre						

		POSITIONEN						EIGENMITTELANFORDERUNGEN	GESAMTRISIKO-BETRAG
		ALLE POSITIONEN		NETTOPOSITIONEN		EINER KAPITALANFORDERUNG UNTERLIEGENDE POSITIONEN			
		KAUFPOSITION	VERKAUFPOSITION	KAUFPOSITION	VERKAUFPOSITION				
						010	020		
120	Bereich 3						060	070	
130	> 4 ≤ 5 (> 3,6 ≤ 4,3 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre								
140	> 5 ≤ 7 (> 4,3 ≤ 5,7 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre								
150	> 7 ≤ 10 (> 5,7 ≤ 7,3 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre								
160	> 10 ≤ 15 (> 7,3 ≤ 9,3 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre								
170	> 15 ≤ 20 (> 9,3 ≤ 10,6 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre								
180	> 20 (> 10,6 ≤ 12,0 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre								
190	(> 12,0 ≤ 20,0 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre								
200	(> 20 für Kupons von weniger als 3 %) Jahre								
210	Durationsbezogener Ansatz								
220	Bereich 1								
230	Bereich 2								
240	Bereich 3								
250	Spezifisches Risiko								
251	Eigenmittelanforderung für Schuldtitel, die keine Verbrieftungspositionen darstellen								
260	Schuldverschreibungen nach der ersten Kategorie in Tabelle 1								

		POSITIONEN						EIGENMITTELANFORDERUNGEN	GESAMTRISIKO-BETRAG
		ALLE POSITIONEN		NETTOPOSITIONEN		EINER KAPITALANFORDERUNG UNTERLIEGENDE POSITIONEN			
		KAUFPOSITION	VERKAUFPOSITION	KAUFPOSITION	VERKAUFPOSITION				
						010	020		
270	Schuldverschreibungen nach der zweiten Kategorie in Tabelle 1						070		
280	Mit einer Restlaufzeit ≤ 6 Monate								
290	Mit einer Restlaufzeit > 6 Monate und ≤ 24 Monate								
300	Mit einer Restlaufzeit > 24 Monate								
310	Schuldverschreibungen nach der dritten Kategorie in Tabelle 1								
320	Schuldverschreibungen nach der vierten Kategorie in Tabelle 1								
321	n-ter-Ausfall-Kreditderivate mit Bonitätsbeurteilung								
325	Eigenmittelanforderung für Verbriefungspositionen								
330	Eigenmittelanforderung für das Korrelationshandelsportfolio								
350	Zusatzanforderungen für Optionen (ohne Delta-Faktor-Risiken)								
360	Vereinfachte Methode								
370	Delta-Plus-Ansatz — Zusatzanforderungen für das Gamma-Risiko								
380	Delta-Plus-Ansatz — Zusatzanforderungen für das Vega-Risiko								
385	Delta-Plus-Ansatz — nicht kontinuierliche Optionen und Optionsscheine								
390	Szenario-Matrixansatz								

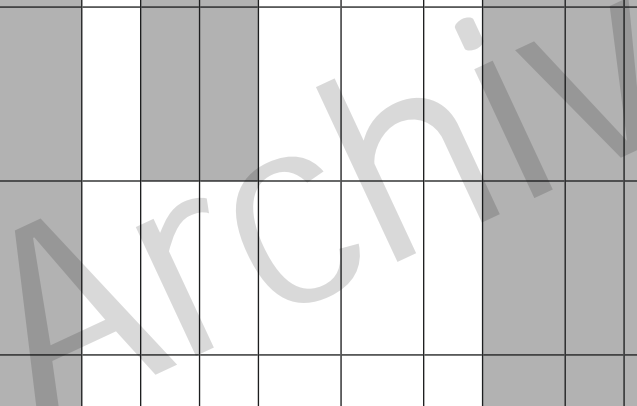
	AUFSCHLÜSSELUNG DER NETTOPOSITION NACH ANSÄTZEN					GESAMTEFFEKT (ANPASSUNG) AUFGRUND VON VERSTÖßEN GEGEN KAPITEL 2 DER VERORDNUNG (EU) 2017/2402		VOR ANWENDUNG DER OBERGRENZE	NACHAN- WENDUNG DER OBERGRENZE/ EIGENMITTELAN- FORDERUNGEN INSGESAMT
	SEC-IRBA	SEC-SA	SEC-ERBA	INTERNER BEMESSUNGS- ANSATZ	SONSTIGE (RW = 1,250%)	GEWICHTETE NETTOKAUF- POSITIONEN	GEWICHTETE NETTOVER- KAUFPOSITIO- NEN		
010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN								
020	Davon: WIEDERVERBRIEFUNGEN								
030	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN								
040	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN								
041	DAVON: FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT								
050	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN								
060	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN								
070	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN								
071	DAVON: FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT								
080	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN								
090	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN								
100	VERBRIEFUNGSPOSITIONEN								
101	DAVON: FÜR EINE DIFFERENZIERTE EIGENMITTELBEHANDLUNG QUALIFIZIERT								
110	WIEDERVERBRIEFUNGSPOSITIONEN								
									Verknüpfung mit MKR SA TDI {325:060}

C 20.00 – MARKTRISIKO: STANDARDANSATZ FÜR DAS SPEZIFISCHE RISIKO IM KORRELATIONSHANDELSPORTFOLIO (MKR SA CTP)						
	ALLE POSITIONEN		(-) VON DEN EIGENMITTELN ABGEZOGENE POSITIONEN		NETTOPOSITIONEN	
	KAUFPOSITION 010	VERKAUFSPPOSITION 020	(-) KAUFPOSITION 030	(-) VERKAUFSPPOSITION 040	KAUFPOSITION 050	VERKAUFSPPOSITION 060
010	GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN					
	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN:					
020	ORIGINATOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN					
030	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN					
040	SONSTIGE CTP-POSITIONEN					
050	ANLEGER: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN					
060	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN					
070	SONSTIGE CTP-POSITIONEN					
080	SPONSOR: GESAMTSUMME DER RISIKOPOSITIONEN					
090	VERBRIEFUNGSPPOSITIONEN					
100	SONSTIGE CTP-POSITIONEN					
	N-TER-AUSEFALL-KREDITDERIVATE:					
110	N-TER-AUSEFALL-KREDITDERIVATE					
120	SONSTIGE CTP-POSITIONEN					

C 21.00 — MARKTRISIKO: STANDARDANSATZ FÜR POSITIONSRISIKEN BEI AKTIENINSTRUMENTEN (MKR SA EQU)

Nationaler Markt:

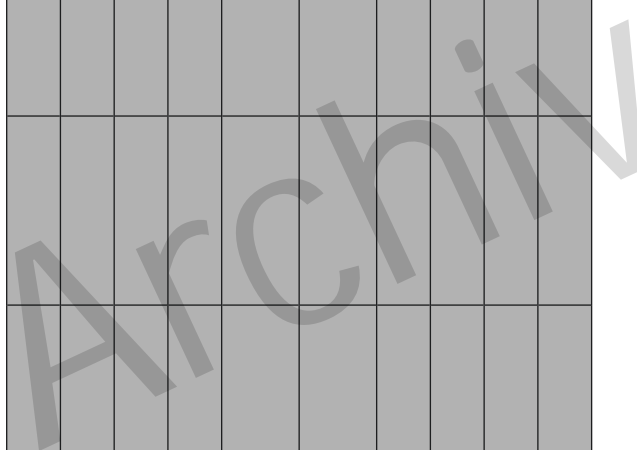
	POSITIONEN							EIGENMITTELANFORDERUNGEN	GESAMTRISIKOBETRAG
	ALLE POSITIONEN		NETTOPOSITIONEN		EINER KAPITALANFORDERUNG UNTERLIEGENDE POSITIONEN				
	KAUFPOSITION	VERKAUFPOSITION	KAUFPOSITION	VERKAUFPOSITION					
010	IM HANDELSBUCH GEHALTENE AKTIENINSTRUMENTE							060	070
020	Allgemeines Risiko								
021	Derivate								
022	Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten								
030	Breit gestreute börsengehandelte Aktienindex-Terminkontrakte, für die ein bestimmter Ansatz gilt								
040	Sonstige Aktieninstrumente außer breit gestreuten börsengehandelten Aktienindex-Terminkontrakten								
050	Spezifisches Risiko								
090	Zusatzanforderungen für Optionen (ohne Delta-Faktor-Risiken)								
100	Vereinfachte Methode								
110	Delta-Plus-Ansatz — Zusatzanforderungen für das Gamma-Risiko								
120	Delta-Plus-Ansatz — Zusatzanforderungen für das Vega-Risiko								
125	Delta-Plus-Ansatz — nicht kontinuierliche Optionen und Optionsscheine								
130	Szenario-Matrixansatz								



C 22.00 — MARKTRISIKO: STANDARDANSÄTZE FÜR DAS FREMDWÄHRUNGSRISSIKO (MKR SA FX)									
	ALLE POSITIONEN		NETTOPOSITIONEN		EINER KAPITALANFORDERUNG UNTERLIEGENDE POSITIONEN (Einschließlich Umverteilung nicht ausgeglichener Positionen in Nicht-Berichtswährungen, für die eine besondere Behandlung für ausgeglichene Positionen gilt)			EIGENMITTEL- ANFORDERUN- GEN	GESAMTRISIKO- BETRAG
	KAUFPOS- TION	VERKAUF- POSITION	KAUFPOS- TION	VERKAUF- POSITION	KAUFPOS- TION	VERKAUF- POSITION	AUSGEGLICHTEN		
	020	030	040	050	060	070	080	090	100
010	POSITIONEN INSGESAMT								
020	Eng verbundene Währungen								
025	davon: Berichtswährung								
030	Alle sonstigen Währungen (unter Einschluss von OGA, die als unterschiedliche Währungen behandelt werden)								
040	Gold								
050	Zusatzanforderungen für Optionen (ohne Delta-Faktor-Risiken)								
060	Vereinfachte Methode								
070	Delta-Plus-Ansatz — Zusatzanforderungen für das Gamma-Risiko								
080	Delta-Plus-Ansatz — Zusatzanforderungen für das Vega-Risiko								
085	Delta-Plus-Ansatz — nicht kontinuierliche Optionen und Optionsscheine								
090	Szenario-Matrixansatz								
AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTEN POSITIONEN (EINSCHLIESSLICH DER BERICHTSWÄHRUNG) NACH RISIKOPOSITIONSARTEN									
100	Sonstige Vermögenswerte außer außerbilanziellen Posten und Derivaten								
110	Außerbilanzielle Posten								
120	Derivate								Verknüpfung mit CA

C 23.00 — MARKTRISIKO: STANDARDANSÄTZE FÜR WARENPOSITIONEN (MKR SA COM)										
	ALLE POSITIONEN			NETTOPOSITIONEN		EINER KAPITALANFORDERUNG UNTERLIEGENDE POSITIONEN	EIGENMITTELANFORDERUNGEN	GESAMTRISIKOBETRAG		
	KAUFPOSITION	VERKAUFSPPOSITION	010	KAUFPOSITION	VERKAUFSPPOSITION				030	040
010	WARENPOSITIONEN INSGESAMT									
020	Edelmetalle (ausgenommen Gold)									
030	Nichtedelmetalle									
040	Agrarerzeugnisse (Weichwaren)									
050	Sonstige									
060	Davon Energieprodukte (Öl, Gas)									
070	Laufzeitbandverfahren									
080	Erweitertes Laufzeitbandverfahren									
090	Vereinfachtes Verfahren: Alle Positionen									
100	Zusatzanforderungen für Optionen (ohne Delta-Faktor-Risiken)									
110	Vereinfachte Methode									
120	Delta-Plus-Ansatz — Zusatzanforderungen für das Gamma-Risiko									
130	Delta-Plus-Ansatz — Zusatzanforderungen für das Vega-Risiko									
135	Delta-Plus-Ansatz — nicht kontinuierliche Optionen und Optionsscheine									
140	Szenario-Matrixansatz									
										Verknüpfung mit CA

	EIGENMITTELANFORDERUNGEN	GESAMTRISIKOBETRAG	Zahl der Überschreitungen während der vorausgesetzten 250 Geschäftstage	VaR Multiplikationsfaktor (m _c)	SVaR Multiplikationsfaktor (m _s)	ANGENOMMENE ANFORDERUNG FÜR DIE CTP-UNTERGRENZE – GEWICHTETE NETTOVERKAUFSPPOSITIONEN NACH ANWENDUNG DER OBERGRENZE	ANGENOMMENE ANFORDERUNG FÜR DIE CTP-UNTERGRENZE – GEWICHTETE NETTOVERKAUFSPPOSITIONEN NACH ANWENDUNG DER OBERGRENZE
010	120	130	140	150	160	170	180
	POSITIONEN INSGESAMT						
	Zusatzinformationen: AUFSCHLÜSSELUNG DES MARKTRISIKOS						
020							
030							
040							
050							
060							
070							
080							
090							
100							
110							



C 25.00 — RISIKO EINER ANPASSUNG DER KREDITBEWERTUNG (CVA)									
	RISIKOPOSITIONSWERT				RISIKOPOTENZIAL (VaR)		RISIKOPOTENZIAL UNTERSTRESSBEDINGUNGEN (sVaR)		LETZTE VERFÜGBARE MASSZAHL (sVaR _{t-1})
	davon: OTC-Derivate	davon: WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE (SFT)	MULTIPLIKATIONSFAKTOR (m _t) x DURCHSCHNITT DER VORAUSGEHANGENEN 60 GESCHÄFTSTAGE (VaR _{avg})	VORTAGESWERT DES RISIKOPOTENZIALS (VaR _{t-1})	MULTIPLIKATIONSFAKTOR (m _t) x DURCHSCHNITT DER VORAUSGEHANGENEN 60 GESCHÄFTSTAGE (sVaR _{avg})	MULTIPLIKATIONSFAKTOR (m _t) x DURCHSCHNITT DER VORAUSGEHANGENEN 60 GESCHÄFTSTAGE (sVaR _{avg})			
010	020	030	040	050	060	070			
010									
020									
030									
040									
	EIGENMITTELANFORDERUNGEN	GESAMTRISIKOKOBETRAG	ZUSATZINFORMATIONEN		NENNBETRÄGE DER ABSICHERUNGEN GEGEN CVA-RISIKEN				
			Anzahl der Gegenparteien	davon: zur Berechnung des Kreditspreads würde ein Näherungswert verwendet	EINGEGANGENE CVA	EINZELADRESSEN-KREDITAUSFALL-SWAP	INDEX-KREDITAUSFALL-SWAPS		
010	080	090	100	110	120	130	140		
020		Verknüpfung mit {CA 2;r6 40;c010}							
030		Verknüpfung mit {CA 2;r6 50;c010}							
040		Verknüpfung mit {CA 2;r6 60;c010}							
		Verknüpfung mit {CA 2;r6 70;c010}							

		KATEGORIESPEZIFISCHE AVAS									
		MARKT- PREISUNSI- CHERHEIT	DAVON: NACH DEM EXPER- TENKONZEPT BERECHNET	GLATT- STEL- LUNGS- KOSTEN	DAVON: NACH DEM EXPER- TENKONZEPT BERECHNET	MO- DELLRI- SIKO	DAVON: NACH DEM EXPER- TENKONZEPT BERECHNET	KONZEN- TRIERTE POSITIO- NEN	KÜNFTIGE VERWAL- TUNGS- KOSTEN	VORZEI- TIGE VER- TRAGS- BEENDI- GUNG	OPE- RATIO- NELLES RISIKO
0010	KERNKONZEPT	0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100
0020	DAVON: HANDELSBUCH										
0030	PORTFOLIOS GEMÄSS DEN ARTIKELN 9 BIS 17 DER DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) 2016/101 – KATEGORIESPEZIFISCHER GESAMTWERT NACH DIVERSIFIZIERUNG										
0040	KATEGORIESPEZIFISCHER GESAMTWERT VOR DIVERSIFIZIERUNG										
0050	DAVON: AVA FÜR NOCH NICHT EINGENOMMENE KREDITSPREADS										
0060	DAVON: AVA FÜR INVESTITIONS- UND FINANZIERUNGSKOSTEN										
0070	DAVON: GEMÄSS ARTIKEL 9 ABSATZ 2 DER DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) 2016/101 MIT NULL BEWERTETE AVA										
0080	DAVON: GEMÄSS ARTIKEL 10 ABSATZ 2 UND 3 DER DELEGIERTEN VERORDNUNG (EU) 2016/101 MIT NULL BEWERTETE AVA										
0090	ZINSSATZ										
0100	DEISEN										
0110	KREDIT										
0120	AKTIENINSTRUMENTE										
0130	WARENPOSITIONEN										

C 32.02 – VORSICHTIGE BEWERTUNG: KERNANSATZ (PRUVAL 2)

0010	1	KERNKONZEPT	GESAMT-AVA	AUFWÄRTSUNSICHERHEIT	ZEITWERTBILANZIERTE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN		QTD-EINNAHMEN	IPV-DIFFERENZ
					ZEITWERTBILANZIERTE VERMÖGENSWERTE	ZEITWERTBILANZIERTE VERBINDLICHKEITEN		
0020		DAVON: HANDELSBUCH	0110	0120	0130	0140	0150	0160
0030	1.1	PORTFOLIOS GEMÄSS DEN ARTIKELN 9 BIS 17 DER DELEGierten VERORDNUNG (EU) 2016/101 – KATEGORIESPEZIFISCHER GESAMTWERT NACH DIVERSIFIZIERUNG						
0040	1.1.1	KATEGORIESPEZIFISCHER GESAMTWERT VOR DIVERSIFIZIERUNG						
0050	1.1.1*	DAVON: AVA FÜR NOCH NICHT EINGENOMMENE KREDITSPREADS						
0060	1.1.1**	DAVON: AVA FÜR INVESTITIONS- UND FINANZIERUNGSKOSTEN						
0070	1.1.1***	DAVON: GEMÄSS ARTIKEL 9 ABSATZ 2 DER DELEGierten VERORDNUNG (EU) 2016/101 MIT NULL BEWERTETE AVA						
0080	1.1.1****	DAVON: GEMÄSS ARTIKEL 10 ABSATZ 2 UND 3 DER DELEGierten VERORDNUNG (EU) 2016/101 MIT NULL BEWERTETE AVA						
0090	1.1.1.1	ZINSSATZ						
0100	1.1.1.2	DEISEN						
0110	1.1.1.3	KREDIT						
0120	1.1.1.4	AKTIENINSTRUMENTE						
0130	1.1.1.5	WARENPOSITIONEN						

	GESAMT-AVA	AUFWÄRTSUNSI- CHERHEIT	ZEITWERTBILANZIERTE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN		QTD- EINNAHMEN	IPV- DIFFERENZ
			ZEITWERTBILAN- ZIERTE VERMÖ- GENSWERTE	ZEITWERTBILAN- ZIERTE VERBIND- LICHKEITEN		
0140	0110	0120	0130	0140	0150	0160
1.1.2						
0150						
0160						
0170						
0180						
0190						
0200						
0210						

(-) DIVERSIFIZIERUNGSVORTEILE

(-) NACH METHODE 1 BERECHNETE DIVERSIFIZIERUNGSVORTEILE

(-) NACH METHODE 2 BERECHNETE DIVERSIFIZIERUNGSVORTEILE

ZUSATZINFORMATION: AVAS VOR DIVERSIFIZIERUNG, DIE DURCH DIE DIVERSIFIZIERUNG NACH METHODE 2 UMM MEHR ALS 90 % GESENKT WERDEN

PORTFOLIOS NACH DEM AUSWEICHKONZEPT

100 % DER NICHT REALISIERTEN GEWINNE

10 % DES NOMINALWERTS

25 % DES WERTS SEIT ABSCHLUSS

	ANPASSUNGEN DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS								ERLÄUTERUNG		
	MARKTPREIS-UNSI-CHERHEIT	GLÄTT-STEL-LUNGS-KOSTEN	MO-DELIR-SIKO	KONZENT-RIERTE POSITIO-NEN	NOCH NICHT EIN-GENOMME-NE KREDIT-SPREADS	INVESTITI-ONS- UND FINANZIE-RUNGSKÖSTEN	KÜNFTIGE VERWAL-TUNGS-KOSTEN	VOR-ZEITIGE VER-TRAGS-BEENDI-GUNG		OPPE-RATIONELLES RISIKO	ERSTAN-SATZGUV
0140	0170	0180	0190	0200	0210	0220	0230	0240	0250	0260	0270
1.1.2	(-) DIVERSIFIZIERUNGSVORTEILE										
1.1.2.1	(-) NACH METHODE 1 BERECHNETE DIVERSIFIZIERUNGSVORTEILE										
1.1.2.2	(-) NACH METHODE 2 BERECHNETE DIVERSIFIZIERUNGSVORTEILE										
1.1.2.2*	ZUSATZINFORMATION: AVAS VOR DIVERSIFIZIERUNG, DIE DURCH DIE DIVERSIFIZIERUNG NACH METHODE 2 UMM MEHR ALS 90% GESENKT WERDEN										
1.2	PORTFOLIOS NACH DEM AUSWEICHKONZEPT										
1.2.1	100 % DER NICHT REALISIERTEN GEWINNE										
1.2.2	10 % DES NOMINALWERTS										
1.2.3	25 % DES WERTS SEIT ABSCHLUSS										

C 32.03 – VORSICHTIGE BEWERTUNG: AVA FÜR DAS MODELLRISIKO (PRUVAL 3)

RANG	MODELL	RISIKOKATEGORIE	PRODUKT	BEOBACHTBARKEIT	AVA FÜR DAS MODELLRISIKO	DAVON: NACH EXPERTEN-KONZEPT		DAVON: AGGREGIERT NACH METHODE 2	NACH METHODE 2 BERECHNETE AGGREGIERTE AVA	ZEITWERTBILANZIERTER VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN		DIFFERENZ IM VERFAHREN DER UNABHÄNGIGEN PREISÜBERPRÜFUNG (IPV-DIFFERENZ) (ERGEBNIS-PRÜFUNG)	IPV-ABDECKUNG (ERGEBNIS-PRÜFUNG)	ANPASSUNGEN DES BEZULEGENDEN ZEITWERTS		ERSTANSATZ-GUV
						ZEITWERT-VERMÖGENSWERTE	ZEITWERT-BILANZIERTER VERBINDLICHKEITEN			MODELLRISIKO	VORZEITIGE VERTRAGSBEENDIGUNG					
0005	0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	

Archiv

C 32.04 – VORSICHTIGE BEWERTUNG: AVA FÜR KONZENTRIERTE POSITION (PRUVAL 4)

RANG	RISIKOKATEGORIE	PRODUKT	BASISWERT	UMFANG DER ZUGRÜNDELIEGENDEN KONZENTRIERTEN POSITION	GRÖSSENEINHEIT	MARKTWERT	VORSICHTIGE AUSSTIEGSPERIODE	AVA FÜR KONZENTRIERTE POSITION	BERICHTIGUNG DES BEZULEGENDEN ZEITWERTS FÜR KONZENTRIERTE POSITIONEN	IPV-DIHERENZ
0005	0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100

Archiv

C 33.00 — RISIKOPOSITIONEN GEGENÜBER STAATEN NACH LAND DER GEGENPARTEI (GOV)

Land:

		Direkte Risikopositionen						
		Bilanzwirksame Risikopositionen						
		Gesamter Bruttobuchwert nicht derivativer finanzieller Vermögenswerte (abzüglich der Verkaufspositionen)	Nicht-derivative finanzielle Vermögenswerte nach Bilanzierungsportfolio			Nicht zum Handelsbestand gehörende finanzielle Vermögenswerte, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewerten sind	Als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete designierte finanzielle Vermögenswerte	Nicht zum Handelsbestand gehörende, nicht derivative, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte	Zum Handelsbestand gehörende finanzielle Vermögenswerte		030	040	050			
010	020	030	040	050	060	070		
010	Gesamtsumme der Risikopositionen							
AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPOSITIONEN NACH RISIKO, REGULIERUNGSANSATZ UND RISIKOPOSITIONSKLASSEN:								
020	Risikopositionen unter dem Kreditrisikorahmen							
030	Standardansatz							
040	Zentralstaaten							
050	Regionale oder lokale Gebietskörperschaften							
060	Öffentliche Stellen							
070	Internationale Organisationen							
075	Sonstige dem Standardansatz unterliegende Risikopositionen gegenüber Staaten							
080	IRB-Ansatz							
090	Zentralstaaten							
100	Regionale und lokale Gebietskörperschaften [Zentralstaaten]							
110	Regionale und lokale Gebietskörperschaften [Institute]							
120	Öffentliche Stellen [Zentralstaaten]							

		Direkte Risikopositionen						
		Bilanzwirksame Risikopositionen						
		Nicht-derivative finanzielle Vermögenswerte nach Bilanzierungsportfolio						
	Gesamter Bruttobuchwert nicht derivativer finanzieller Vermögenswerte (abzüglich der Verkaufspositionen)	Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte	Zum Handelsbestand gehörende finanzielle Vermögenswerte	Nicht zum Handelsbestand gehörende finanzielle Vermögenswerte, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewerten sind	Als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete designierte finanzielle Vermögenswerte	Nicht zum Handelsbestand gehörende, nicht-derivative, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte		
	010	020	030	040	050	060	070	
130	Öffentliche Stellen [Institute]							
140	Internationale Organisationen [Zentralstaaten]							
155	Sonstige dem IRB-Ansatz unterliegende Risikopositionen gegenüber Staaten							
160	Risikopositionen unter dem Marktrisikorahmen							
AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPPOSITIONEN NACH RESTLAUFZEIT:								
170	[0 — 3M]							
180	[3M — 1J]							
190	[1J — 2J]							
200	[2J — 3J]							
210	[3J — 5J]							
220	[5J — 10J]							
230	[10J und mehr]							

		Direkte Risikopositionen							
		Bilanzwirksame Risikopositionen							
		Nicht-derivative finanzielle Vermögenswerte nach Bilanzierungsportfolio							
		Finanzielle Vermögenswerte, die erfolgsneutral zum beizulegenden Zeitwert im sonstigen Ergebnis bewertet werden	Nicht zum Handelsbestand gehörende, nicht derivative, erfolgsneutral im Eigenkapital zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	Zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertete finanzielle Vermögenswerte	Nicht zum Handelsbestand gehörende, nicht derivative, nach einer kostenbezogenen Methode bewertete finanzielle Vermögenswerte	Sonstige nicht zum Handelsbestand gehörende, nicht derivative, nicht finanzielle Vermögenswerte	Verkaufspositionen	Davon: als zu Handelszwecken gehalten oder zum Handelsbestand gehörende eingestufte Verkaufspositionen aus Darlehen aus umgekehrten Pensionsgeschäften	
		080	090	100	110	120	130	140	
010	Gesamtsumme der Risikopositionen								
AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPPOSITIONEN NACH RISIKO, REGULIERUNGSANSATZ UND RISIKOPOSITIONSKLASSEN:									
020	Risikopositionen unter dem Kreditrisikorahmen								
030	Standardansatz								
040	Zentralstaaten								
050	Regionale oder lokale Gebietskörperschaften								
060	Öffentliche Stellen								
070	Internationale Organisationen								
075	Sonstige dem Standardansatz unterliegende Risikopositionen gegenüber Staaten								
080	IRB-Ansatz								
090	Zentralstaaten								
100	Regionale und lokale Gebietskörperschaften [Zentralstaaten]								
110	Regionale und lokale Gebietskörperschaften [Institute]								
120	Öffentliche Stellen [Zentralstaaten]								

		Direkte Risikopositionen							
		Bilanzwirksame Risikopositionen							
		Nicht-derivative finanzielle Vermögenswerte nach Bilanzierungsportfolio							
		Finanzielle Vermögenswerte, die erfolgsneutral zum beizulegenden Zeitwert im sonstigen Ergebnis bewertet werden	Nicht zum Handelsbestand gehörende, nicht derivative im Eigenkapital zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	Zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertete finanzielle Vermögenswerte	Nicht zum Handelsbestand gehörende, nicht derivative, nach einer kostenbezogenen Methode bewertete finanzielle Vermögenswerte	Sonstige nicht zum Handelsbestand gehörende, nicht derivative, nicht finanzielle Vermögenswerte	Verkaufspositionen	Davon: als zu Handelszwecken gehalten oder zum Handelsbestand gehörende enggestufte Verkaufspositionen aus Darlehen aus umgekehrten Pensionsgeschäften	
		080	090	100	110	120	130	140	
130	Öffentliche Stellen [Institute]								
140	Internationale Organisationen [Zentralstaaten]								
155	Sonstige dem IRB-Ansatz unterliegende Risikopositionen gegenüber Staaten								
160	Risikopositionen unter dem Marktrisikorahmen								
AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPOSITIONEN NACH RESTLAUFZEIT:									
170	[0 — 3M]								
180	[3M — 1J]								
190	[1J — 2J]								
200	[2J — 3J]								
210	[3J — 5J]								
220	[5J — 10J]								
230	[10J und mehr]								

	Direkte Risikopositionen			Zusatzinformation: verkaufte Kreditderivate auf Risikopositionen gegenüber Staaten		Risikopositionswert	Risikogewichteter Positionsbetrag
	Außerbilanzielle Risikopositionen			Derivate mit positivem beizulegendem Zeitwert — Buchwert	Derivate mit negativem beizulegendem Zeitwert — Buchwert		
	Nominalbetrag	Rückstellungen	Kumulierte negative Änderungen beim beizulegenden Zeitwert aufgrund von Ausfallrisiken				
010	240	250	260	270	280	290	300
Gesamtsumme der Risikopositionen							
AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPPOSITIONEN NACH RISIKO, REGULIERUNGSANSATZ UND RISIKOPPOSITIONSKLASSEN:							
020							
Risikopositionen unter dem Kreditrisikorahmen							
030							
Standardansatz							
040							
Zentralstaaten							
050							
Regionale oder lokale Gebietskörperschaften							
060							
Öffentliche Stellen							
070							
Internationale Organisationen							
075							
Sonstige dem Standardansatz unterliegende Risikopositionen gegenüber Staaten							
080							
IRB-Ansatz							
090							
Zentralstaaten							
100							
Regionale und lokale Gebietskörperschaften [Zentralstaaten]							
110							
Regionale und lokale Gebietskörperschaften [Institute]							
120							
Öffentliche Stellen [Zentralstaaten]							

	Direkte Risikopositionen				Zusatzinformation: verkaufte Kreditderivate auf Risikopositionen gegenüber Staaten		Risikopositionswert	Risikogewichteter Positionsbetrag
	Außerbilanzielle Risikopositionen		Kumulierte negative Änderungen beim beizulegenden Zeitwert aufgrund von Ausfallrisiken	Derivate mit positivem beizulegendem Zeitwert — Buchwert	Derivate mit negativem beizulegendem Zeitwert — Buchwert			
	Nominalbetrag	Rückstellungen						
130	240	250	260	270	280	290	300	
130	Öffentliche Stellen [Institute]							
140	Internationale Organisationen [Zentralstaaten]							
155	Sonstige dem IRB-Ansatz unterliegende Risikopositionen gegenüber Staaten							
160	Risikopositionen unter dem Marktrisikorahmen							
AUFSCHLÜSSELUNG DER GESAMTRISIKOPPOSITIONEN NACH RESTLAUFZEIT:								
170	[0 — 3M]							
180	[3M — 1J]							
190	[1J — 2J]							
200	[2J — 3J]							
210	[3J — 5J]							
220	[5J — 10J]							
230	[10J und mehr]							