

„ANHANG XXIV

LIQUIDITÄTSMELDUNGEN

MELDEBÖGEN ZUR LIQUIDITÄT		
Meldebogen-nummer	Meldebogen-code	Bezeichnung des Meldebogens/der Meldebogen-Gruppe
MELDEBÖGEN ZUR LIQUIDITÄTSDECKUNG		
		TEIL I — LIQUIDE AKTIVA
72	C 72.00	LIQUIDITÄTSDECKUNG — LIQUIDE AKTIVA
		TEIL II — ABFLÜSSE
73	C 73.00	LIQUIDITÄTSDECKUNG — ABFLÜSSE
		TEIL III — ZUFLÜSSE
74	C 74.00	LIQUIDITÄTSDECKUNG — ZUFLÜSSE
		TEIL IV — SICHERHEITENSWAPS
75	C 75.01	LIQUIDITÄTSDECKUNG — SICHERHEITENSWAPS
		TEIL V — BERECHNUNGEN
76	C 76.00	LIQUIDITÄTSDECKUNG — BERECHNUNGEN
		TEIL VI — KONSOLIDIERUNGSKREIS
77	C 77.00	LIQUIDITÄTSDECKUNG — KONSOLIDIERUNGSKREIS

C 72.00 – LIQUIDITÄTSDECKUNG – LIQUIDE AKTIVA

Währung

Zeile	ID	Posten	Betrag/ Marktwert 010	Standard- gewichtung 020	Anwendbare Gewichtung 030	Wert gemäß Artikel 9 040
010	1	SUMME DER UNBEREINIGTEN LIQUIDEN AKTIVA				
020	1.1	Summe der unberichtigten Aktiva der Stufe 1				
030	1.1.1	Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität				
040	1.1.1.1	Münzen und Banknoten			1,00	
050	1.1.1.2	Abziehbare Zentralbankreserven			1,00	
060	1.1.1.3	Zentralbank-Aktiva			1,00	
070	1.1.1.4	Zentralstaat-Aktiva			1,00	
080	1.1.1.5	Aktiva von regionalen/lokalen Gebietskörperschaften			1,00	
090	1.1.1.6	Aktiva von öffentlichen Stellen			1,00	
100	1.1.1.7	Ansetzbare Zentralstaat- oder Zentralbank-Aktiva in Landes- oder Fremdwährung			1,00	
110	1.1.1.8	Aktiva von Kreditinstituten (von Instituten, die durch einen Mitgliedstaat geschützt sind bzw. Förderdarlehen ausreichen)			1,00	
120	1.1.1.9	Aktiva von multilateralen Entwicklungsbanken und internationalen Organisationen			1,00	
130	1.1.1.10	Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit Münzen/Banknoten und/oder Risikopositionen der Zentralbank als zugrunde liegende Aktiva			1,00	
140	1.1.1.11	Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, als zugrunde liegenden Vermögenswerten			0,95	

Zeile	ID	Posten	Betrag/ Marktwert	Standard- gewichtung	Anwendbare Gewichtung	Wert gemäß Artikel 9 040
			010	020	030	
150	1.1.1.12	Alternative Liquiditätsansätze: Kreditfazilität einer Zentralbank			1,00	
160	1.1.1.13	Zentralinstitute: Aktiva der Stufe 1 ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, die als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden				
170	1.1.1.14	Alternative Liquiditätsansätze: Aktiva der Stufe 2A, die als Stufe 1 anerkannt werden			0,80	
180	1.1.2	Summe der unbereinigten gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1				
190	1.1.2.1	Gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität			0,93	
200	1.1.2.2	Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität als zugrunde liegende Aktiva			0,88	
210	1.1.2.3	Zentralinstitute: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1, die als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden				
220	1.2	Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 2				
230	1.2.1	Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 2A				
240	1.2.1.1	Aktiva von Regionalregierungen, lokalen Gebietskörperschaften oder öffentlichen Stellen (Mitgliedstaat, Risikogewicht 20 %)			0,85	
250	1.2.1.2	Aktiva einer Zentralbank oder einer Zentral-/Regionalregierung, lokalen Gebietskörperschaft oder öffentlichen Stelle (Drittland, Risikogewicht 20 %)			0,85	
260	1.2.1.3	Gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität (Bonitätsstufe 2)			0,85	
270	1.2.1.4	Gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität (Drittland, Bonitätsstufe 1)			0,85	
280	1.2.1.5	Unternehmensschuldverschreibungen (Bonitätsstufe 1)			0,85	
290	1.2.1.6	Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit Aktiva der Stufe 2A als zugrunde liegende Aktiva			0,80	

Zeile	ID	Posten	Betrag/ Marktwert 010	Standard- gewichtung 020	Anwendbare Gewichtung 030	Wert gemäß Artikel 9 040
300	1.2.1.7	Zentralinstitute: Aktiva der Stufe 2A, die als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden				
310	1.2.2	Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 2B				
320	1.2.2.1	Forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien, Bonitätsstufe 1)			0,75	
330	1.2.2.2	Forderungsbesicherte Wertpapiere (Kfz, Bonitätsstufe 1)			0,75	
340	1.2.2.3	Gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität (Risikogewicht 35 %)			0,70	
350	1.2.2.4	Forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)			0,65	
360	1.2.2.5	Unternehmensschuldverschreibungen (Bonitätsstufen 2/3)			0,50	
370	1.2.2.6	Unternehmensschuldverschreibungen — nicht zinsbringende Aktiva (von Kreditinstituten aus Gründen der Glaubenslehre gehalten) (Bonitätsstufen 1/2/3)			0,50	
380	1.2.2.7	Aktien (wichtiger Aktienindex)			0,50	
390	1.2.2.8	Nicht zinsbringende Aktiva (von Kreditinstituten aus Gründen der Glaubenslehre gehalten) (Bonitätsstufen 3–5)			0,50	
400	1.2.2.9	Eingeschränkt nutzbare zugesagte Liquiditätsfazilitäten von Zentralbanken			1,00	
410	1.2.2.10	Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mitforderungsbesicherten Wertpapieren als zugrunde liegende Aktiva (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)			0,70	
420	1.2.2.11	Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit gedeckten Schuldverschreibungen hoher Qualität als zugrunde liegende Aktiva (Risikogewicht 35 %)			0,65	
430	1.2.2.12	Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mitforderungsbesicherten Wertpapieren als zugrunde liegende Aktiva (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)			0,60	

Zeile	ID	Posten	Betrag/ Marktwert 010	Standard- gewichtung 020	Anwendbare Gewichtung 030	Wert gemäß Artikel 9 040
440	1.2.2.13	Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit Unternehmensschuldverschreibungen (Bonitätsstufen 2/3), Aktien (wichtiger Aktienindex) oder nicht zinsbringende Aktiva (von Kreditinstituten aus Gründen der Glaubenslehre gehalten) (Bonitätsstufen 3–5) als zugrunde liegende Aktiva		0,45		
450	1.2.2.14	Einlagen von Verbundsmitgliedern bei Zentralinstituten (keine Pflichtinvestition)		0,75		
460	1.2.2.15	Liquiditätsfinanzierung für Verbundsmitglieder durch das Zentralinstitut (nicht festgelegte Sicherung)		0,75		
470	1.2.2.16	Zentralinstitute: Aktiva der Stufe 2B, die als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden				
ZUSATZINFORMATIONEN						
485	2	Einlagen von Verbundsmitgliedern bei Zentralinstituten (Pflichtinvestition)				
580	3	Aktiva der Stufen 1/2A/2B, die aus Währungsgründen ausgeschlossen werden				
590	4	Aktiva der Stufen 1/2A/2B, die aus operativen Gründen, ausgenommen Währungsgründe, ausgeschlossen werden				

C 73.00 – LIQUIDITÄTSDECKUNG – ABFLÜSSE**Währung**

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
010	1	ABFLÜSSE		010	020	030	040	050
020	1.1	Abflüsse aus unbesicherten Geschäften/Einlagen						060
030	1.1.1	Privatkundeneinlagen						
035	1.1.1.1	Einlagen, die bei der Berechnung der Abflüsse ausgeschlossen sind			0,00			
040	1.1.1.2	Einlagen, bei denen die Auszahlung in den nächsten 30 Kalendertagen vereinbart wurde			1,00			
050	1.1.1.3	Einlagen, die höheren Abflüssen unterliegen						
060	1.1.1.3.1	Kategorie 1				0,10-0,15		
070	1.1.1.3.2	Kategorie 2				0,15-0,20		
080	1.1.1.4	Stabile Einlagen				0,05		
090	1.1.1.5	Stabile Einlagen mit angewandter Ausnahmeregelung				0,03		
100	1.1.1.6	Einlagen in Drittländern, bei denen ein höherer Abfluss angewendet wird						
110	1.1.1.7	Andere Privatkundeneinlagen				0,10		
120	1.1.2	Operative Einlagen						
130	1.1.2.1	Für Clearing-, Verwahr-, Gelddispositionen- oder andere vergleichbare Dienstleistungen im Rahmen einer etablierten Geschäftsbeziehung gehalten						
140	1.1.2.1.1	Durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt				0,05		
150	1.1.2.1.2	Nicht durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt				0,25		

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
160	1.1.2.2	In einem institutsbezogenen Sicherungssystem oder Genossenschaftsbund gehalten	010	020	030	040	050	060
170	1.1.2.2.1	Nicht als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut behandelt				0,25		
180	1.1.2.2.2	Als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut behandelt				1,00		
190	1.1.2.3	Im Rahmen einer (anderen) etablierten Geschäftsbeziehung mit Nichtfinanzkunden gehalten				0,25		
200	1.1.2.4	Für die Zahlungsverkehrsberechnung (Cash Clearing) und für Dienstleistungen eines Zentralinstituts innerhalb eines Verbunds gehalten				0,25		
203	1.1.3	Überschüssige operative Einlagen						
204	1.1.3.1	Einlagen von Finanzkunden				1,00		
205	1.1.3.2	Einlagen von anderen Kunden						
206	1.1.3.2.1	Durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt				0,20		
207	1.1.3.2.2	Nicht durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt				0,40		
210	1.1.4	Nicht operative Einlagen						
220	1.1.4.1	Einlagen, die sich aus einer Korrespondenzbankbeziehung oder aus der Erbringung von Primebroker-Dienstleistungen ergeben				1,00		
230	1.1.4.2	Einlagen von Finanzkunden				1,00		
240	1.1.4.3	Einlagen von anderen Kunden						
250	1.1.4.3.1	Durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt				0,20		
260	1.1.4.3.2	Nicht durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt				0,40		

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standard- gewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
270	1.1.5	Zusätzliche Abflüsse		010	020	030	040	050
280	1.1.5.1	Andere Sicherheiten als für Derivate hinterlegte Sicherheiten in Form von Aktiva der Stufe 1				0,20		
290	1.1.5.2	Für Derivate hinterlegte Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1				0,10		
300	1.1.5.3	Wesentliche Abflüsse infolge der Verschlechterung der eigenen Bonität				1,00		
310	1.1.5.4	Auswirkungen ungünstiger Marktbedingungen auf Derivatgeschäfte				1,00		
340	1.1.5.5	Abflüsse aus Derivaten				1,00		
350	1.1.5.6	Leerverkaufpositionen					1,00	
360	1.1.5.6.1	Durch besicherte Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gedeckt				0,00		
370	1.1.5.6.2	Sonstiges					1,00	
380	1.1.5.7	Einforderbare überschüssige Sicherheiten					1,00	
390	1.1.5.8	Fällige Sicherheiten					1,00	
400	1.1.5.9	Sicherheiten in Form liquider Aktiva, die durch nicht liquide Aktiva ersetzt werden können					1,00	
410	1.1.5.10	Verlust an Finanzmitteln aus strukturierten Finanzierungsinstrumenten						
420	1.1.5.10.1	Strukturierte Finanzierungsinstrumente					1,00	
430	1.1.5.10.2	Finanzierungsfazilitäten					1,00	
450	1.1.5.11	Interne Aufrechnung der Positionen von Kunden					0,50	
460	1.1.6	Zugesagte Fazilitäten						

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standard- gewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
470	1.1.6.1	Kreditfazilitäten		010	020	040	050	060
480	1.1.6.1.1	Für Privatkunden				0,05		
490	1.1.6.1.2	Für andere Nichtfinanzkunden als Privatkunden				0,10		
500	1.1.6.1.3	Für Kreditinstitute						
510	1.1.6.1.3.1	Zur Finanzierung von Förderdarlehen für Privatkunden				0,05		
520	1.1.6.1.3.2	Zur Finanzierung von Förderdarlehen für Nichtfinanzkunden				0,10		
530	1.1.6.1.3.3	Sonstiges				0,40		
540	1.1.6.1.4	Für andere beaufsichtigte Finanzinstitute als Kreditinstitute				0,40		
550	1.1.6.1.5	In einer Gruppe oder einem institutsbezogenen Sicherungssystem, sofern bevorzugter Behandlung unterliegend						
560	1.1.6.1.6	In einem institutsbezogenen Sicherungssystem oder Genossenschaftsverbund, sofern als liquides Aktivum für das einlegende Institut behandelt				0,75		
570	1.1.6.1.7	Für andere Finanzkunden				1,00		
580	1.1.6.2	Liquiditätsfazilitäten					0,05	
590	1.1.6.2.1	Für Privatkunden					0,30	
600	1.1.6.2.2	Für andere Nichtfinanzkunden als Privatkunden					0,40	
610	1.1.6.2.3	Für private Beteiligungsgesellschaften						
620	1.1.6.2.4	Für Verbriefungszweckgesellschaften						

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
630	1.1.6.2.4.1	Für den Erwerb anderer Vermögenswerte als Wertpapiere von Nichtfinanzkunden	010	020	0,30	040	050	060
640	1.1.6.2.4.2	Sonstiges				0,10		
650	1.1.6.2.5	Für Kreditinstitute				1,00		
660	1.1.6.2.5.1	Zur Finanzierung von Förderdarlehen für Privatkunden				0,05		
670	1.1.6.2.5.2	Zur Finanzierung von Förderdarlehen für Nichtfinanzkunden				0,30		
680	1.1.6.2.5.3	Sonstiges				0,40		
690	1.1.6.2.6	In einer Gruppe oder einem institutsbezogenen Sicherungssystem, sofern bevorzugter Behandlung unterliegend						
700	1.1.6.2.7	In einem institutsbezogenen Sicherungssystem oder Genossenschaftsverband, sofern als liquides Aktivum für das einlegende Institut behandelt				0,75		
710	1.1.6.2.8	Für andere Finanzkunden				1,00		
720	1.1.7	Andere Produkte und Dienstleistungen						
731	1.1.7.1	Nicht zweckgebundene Finanzierungsfazilitäten						
740	1.1.7.2	Nicht in Anspruch genommene Darlehen und Buchkredite an Großkunden						
750	1.1.7.3	Vereinbarte, aber noch nicht in Anspruch genommene Hypothekendarlehen						
760	1.1.7.4	Kreditkarten						
770	1.1.7.5	Überziehungskredite						
780	1.1.7.6	Geplante Abflüsse in Zusammenhang mit der Verlängerung oder der Vergabe neuer Privat- oder Großkundenkredite						

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standard- gewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
850	1.1.7.7	Derivateverbindlichkeiten		010	020	030	040	050
860	1.1.7.8	Außerbilanzielle Posten für die Handelsfinanzierung						
870	1.1.7.9	Andere						
885	1.1.8	Sonstige Verbindlichkeiten und fällige Verpflichtungen						
890	1.1.8.1	Verbindlichkeiten aus Betriebskosten			0,00			
900	1.1.8.2	In Form von Schuldverschreibungen, sofern nicht als Privatkundeneinlagen behandelt				1,00		
912	1.1.8.4	Überschreitung der Finanzierung gegenüber Nichtfinanzkunden						
913	1.1.8.4.1	Überschreitung der Finanzierung gegenüber Privatkunden					1,00	
914	1.1.8.4.2	Überschreitung der Finanzierung gegenüber Nichtfinanzunternehmen					1,00	
915	1.1.8.4.3	Überschreitung der Finanzierung gegenüber Staaten, multilateralen Entwicklungsbanken und öffentlichen Stellen					1,00	
916	1.1.8.4.4	Überschreitung der Finanzierung gegenüber anderen juristischen Personen					1,00	
917	1.1.8.5	Vermögenswerte, die auf unbesicherter Basis geliehen wurden					1,00	
918	1.1.8.6	Andere					1,00	
920	1.2	Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarktransaktionen						
930	1.2.1	Gegenpartei ist Zentralbank						
940	1.2.1.1	Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität					0,00	
945	1.2.1.1.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
950	1.2.1.2	Sicherheiten der Stufe 1 in Form von Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität	010	020	030	040	050	060
955	1.2.1.2.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					0,00	
960	1.2.1.3	Sicherheiten der Stufe 2A				0,00		
965	1.2.1.3.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					0,00	
970	1.2.1.4	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)				0,00		
975	1.2.1.4.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					0,00	
980	1.2.1.5	Gedeckte Schuldverschreibungen der Stufe 2B				0,00		
985	1.2.1.5.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					0,00	
990	1.2.1.6	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)					0,00	
995	1.2.1.6.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					0,00	
1000	1.2.1.7	Andere Sicherheiten in Form von Aktiva der Stufe 2B					0,00	
1005	1.2.1.7.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1010	1.2.1.8	Sicherheiten in Form nicht liquider Aktiva					0,00	
1020	1.2.2	Gegenpartei ist keine Zentralbank						
1030	1.2.2.1	Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität					0,00	
1035	1.2.2.1.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standard-gewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
1040	1.2.2.2	Sicherheiten der Stufe 1 in Form von Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität	010	020	030	040	050	060
1045	1.2.2.2.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					0,07	
1050	1.2.2.3	Sicherheiten der Stufe 2A					0,15	
1055	1.2.2.3.1	Davon: Ausgerechte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1060	1.2.2.4	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)					0,25	
1065	1.2.2.4.1	Davon: Ausgerechte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1070	1.2.2.5	Gedeckte Schuldverschreibungen der Stufe 2B					0,30	
1075	1.2.2.5.1	Davon: Ausgerechte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1080	1.2.2.6	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Migrilstaat, Bonitätsstufe 1)					0,35	
1085	1.2.2.6.1	Davon: Ausgerechte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1090	1.2.2.7	Andere Sicherheiten in Form von Aktiva der Stufe 2B					0,50	
1095	1.2.2.7.1	Davon: Ausgerechte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1100	1.2.2.8	Sicherheiten in Form nicht liquider Aktiva					1,00	
1130	1.3	Summe der Abflüsse aus Sicherheitswaps						

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standard- gewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
ZUSATZINFORMATIONEN								
1170	2	Liquiditätsabflüsse, die mit den einhergehenden Zuflüssen saldiert werden müssen						
3		Operative Einlagen für Clearing-, Verwahr-, Gelddispositions- oder andere vergleichbare Dienstleistungen im Rahmen einer etablierten Geschäftsbeziehung						
1180	3.1	Durch Kreditinstitute bereitgestellt						
1190	3.2	Durch andere Finanzkunden als Kreditinstitute bereitgestellt						
1200	3.3	Durch Staaten, Zentralbanken, multilaterale Entwicklungsbanken und öffentliche Stellen bereitgestellt						
1210	3.4	Durch andere Kunden bereitgestellt						
4 Abflüsse innerhalb gruppeninterner und institutsinterner Sicherungssysteme								
1290	4.1	Davon: für Finanzkunden						
1300	4.2	Davon: für Nichtfinanzkunden						
1310	4.3	Davon: besichert						
1320	4.4	Davon: Kreditfazilitäten ohne bevorzugte Behandlung						
1330	4.5	Davon: Liquiditätsfazilitäten ohne bevorzugte Behandlung						
1340	4.6	Davon: operative Einlagen						
1345	4.7	Davon: Überschüssige operative Einlagen						
1350	4.8	Davon: nicht operative Einlagen						

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standard- gewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
1360	4.9	Davon: Verbindlichkeiten in Form von Schuldverschreibungen, sofern nicht als Privatkundeneinlagen behandelt						
1370	5	Fremdwährungsabflüsse						
6		Von Artikel 17 Absätze 2 und 3 freigestellte besicherte Finanzierung						
1400	6.1	Davon: besichert durch Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität						
1410	6.2	Davon: besichert durch gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität der Stufe 1						
1420	6.3	Davon: besichert durch Aktiva der Stufe 2A						
1430	6.4	Davon: besichert durch Aktiva der Stufe 2B						
1440	6.5	Davon: besichert durch nicht liquide Aktiva						

C 74.00 — LIQUIDITÄTSDECKUNG — ZUFLÜSSE

Währung

Zeile	ID	Posten	Marktwert der empfangenen Sicherheiten				Standardgewichtung
			Betrag	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	
010	1	ZUFLÜSSE INSGESAMT					070
020	1.1	Zuflüsse aus unbesicherten Geschäften/Einlagen					
030	1.1.1	Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken)					
040	1.1.1.1	Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken), die keiner Kapitalrückzahlung entsprechen					1,00
050	1.1.1.2	Andere fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken)					
060	1.1.1.2.1	Fällige Zahlungen von Privatkunden					0,50
070	1.1.1.2.2	Fällige Zahlungen von Nichtfinanzunternehmen					0,50
080	1.1.1.2.3	Fällige Zahlungen von Staaten, multilateralen Entwicklungsbanken und öffentlichen Stellen					0,50
090	1.1.1.2.4	Fällige Zahlungen von anderen juristischen Personen					0,50
100	1.1.2	Fällige Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden					
110	1.1.2.1	Fällige Zahlungen von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind					

Zeile	ID	Posten	Betrag			Marktwert der empfangenen Sicherheiten			
			Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Standardgewichtung	
			010	020	030	040	050	060	070
120	1.1.2.1.1	Fällige Zahlungen von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind, wobei das Kreditinstitut eine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln kann							
130	1.1.2.1.2	Fällige Zahlungen von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind, wobei das Kreditinstitut keine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln kann						0,05	
140	1.1.2.2	Fällige Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden, die nicht als operative Einlagen eingestuft sind							
150	1.1.2.2.1	Fällige Zahlungen von Zentralbanken.						1,00	
160	1.1.2.2.2	Fällige Zahlungen von Finanzkunden						1,00	
170	1.1.3	Zuflüsse in Verbindung mit Abflüssen im Einklang mit Förderdarlehenszusagen gemäß Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.						1,00	
180	1.1.4	Fällige Zahlungen aus Handelsfinanzierungsgeschäften						1,00	
190	1.1.5	Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden						1,00	
201	1.1.6	Darlehen mit unbestimmtem vertraglichem Endtermin						0,20	
210	1.1.7	Fällige Zahlungen aus Positionen in Eigenkapitalinstrumenten eines wichtigen Indexes, sofern sie nicht gleichzeitig als liquide Aktiva erfasst werden						1,00	
230	1.1.8	Zuflüsse aus der Freigabe von Salden, die im Einklang mit Vorschriften für die Sicherung von Kundenhandelsaktiva auf getrennten Konten geführt werden						1,00	

Zeile	ID	Posten	Betrag		Marktwert der empfangenen Sicherheiten		Standardgewichtung
			Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	
240	1.1.9	Zuflüsse aus Derivaten	010	020	030	040	050
250	1.1.10	Zuflüsse aus nicht in Anspruch genommenen Kredit- bzw. Liquiditätsfazilitäten, die durch Mitglieder einer Gruppe oder eines institutbezogenen Sicherungssystems bereitgestellt wurden, wobei die zuständige Behörde die Anwendung einer günstigeren Zuflussrate genehmigt hat					1,00
260	1.1.11	Andere Zuflüsse					1,00
263	1.2	Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarktransaktionen					
265	1.2.1	Gegenpartei ist Zentralbank					
267	1.2.1.1	Sicherheiten, die als liquide Aktiva anerkannt werden					
269	1.2.1.1.1	Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität					0,00
271	1.2.1.1.1.1	Davon: Empfängene Anforderungen	Sicherheiten	erfüllen	die operativen		
273	1.2.1.1.1.2	Sicherheiten der Stufe 1 in Form gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität					0,07
275	1.2.1.1.2.1	Davon: Empfängene Anforderungen	Sicherheiten	erfüllen	die operativen		
277	1.2.1.1.3	Sicherheiten der Stufe 2A					0,15
279	1.2.1.1.3.1	Davon: Empfängene Anforderungen	Sicherheiten	erfüllen	die operativen		
281	1.2.1.1.4	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz)					0,25
283	1.2.1.1.4.1	Davon: Empfängene Anforderungen	Sicherheiten	erfüllen	die operativen		
285	1.2.1.1.5	Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B					0,30
287	1.2.1.1.5.1	Davon: Empfängene Anforderungen	Sicherheiten	erfüllen	die operativen		

Zeile	ID		Posten	Betrag			Marktwert der empfangenen Sicherheiten		
				Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Standardgewichtung
			010	020	030	040	050	060	070
289	1.2.1.1.6	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen)							0,35
291	1.2.1.1.6.1	Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
293	1.2.1.1.7	Sicherheiten der Stufe 2B, die nicht bereits in den Abschnitten 1.2.1.4., 1.2.1.5. oder 1.2.1.6. erfasst wurden							0,50
295	1.2.1.1.7.1	Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
297	1.2.1.2	Sicherheiten zur Deckung von Leerverkaufpositionen							
299	1.2.1.3	Sicherheiten, die nicht als liquide Aktiva anerkannt werden							
301	1.2.1.3.1	Sicherheiten sind nicht liquide Eigenmittel							1,00
303	1.2.1.3.2	Alle anderen nicht liquiden Sicherheiten							1,00
305	1.2.2	Gegenpartei ist keine Zentralbank							
307	1.2.2.1	Sicherheiten, die als liquide Aktiva anerkannt werden							
309	1.2.2.1.1	Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität							0,00
311	1.2.2.1.1.1	Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
313	1.2.2.1.2	Sicherheiten der Stufe 1 in Form gedeckter Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität							0,07
315	1.2.2.1.2.1	Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
317	1.2.2.1.3	Sicherheiten der Stufe 2A							
319	1.2.2.1.3.1	Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
321	1.2.2.1.4	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnummobilien oder Kfz)							0,25

Zeile	ID		Posten	Betrag		Marktwert der empfangenen Sicherheiten		Standardgewichtung
				Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse ausgenommen	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	
323	1.2.2.1.4.1	Davon: Empfängene Anforderungen	Sicherheiten erfüllen die operativen	010	020	030	040	050
325	1.2.2.1.5	Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B						0,30
327	1.2.2.1.5.1	Davon: Empfängene Anforderungen	Sicherheiten erfüllen die operativen					
329	1.2.2.1.6	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen)						0,35
331	1.2.2.1.6.1	Davon: Empfängene Anforderungen	Sicherheiten erfüllen die operativen					
333	1.2.2.1.7	Sicherheiten der Stufe 2B, die nicht bereits in den Abschnitten 1.2.2.4., 1.2.2.5. oder 1.2.2.6. erfasst wurden						0,50
335	1.2.2.1.7.1	Davon: Empfängene Anforderungen	Sicherheiten erfüllen die operativen					
337	1.2.2.2	Sicherheiten zur Deckung von Leerverkaufpositionen						
339	1.2.2.3	Sicherheiten, die nicht als liquide Aktiva anerkannt werden						
341	1.2.2.3.1	Lombardgeschäfte; Sicherheiten sind nicht liquide						0,50
343	1.2.2.3.2	Sicherheiten sind nicht liquide Eigenmittel						1,00
345	1.2.2.3.3	Alle anderen nicht liquiden Sicherheiten						1,00
410	1.3	Summe der Zuflüsse aus Sicherheitswaps						
420	1.4	(Differenz zwischen der Summe der gewichteten Zuflüsse und der Summe der gewichteten Abflüsse aus Drittländern, in denen Transferbeschränkungen gelten oder die auf nichtkonvertierbare Währungen lauten)						
430	1.5	(Überschüssige Zuflüsse von einem verbundenen spezialisierten Kreditinstitut)						

Zeile	ID	Posten	Betrag		Marktwert der empfangenen Sicherheiten		Standardgewichtung
			Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	
ZUSATZINFORMATIONEN							
450	2	Fremdwährungszuflüsse					
460	3	Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems					
470	3.1	Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken)					
480	3.2	Fällige Zahlungen von Finanzkunden					
490	3.3	Besicherte Transaktionen					
500	3.4	Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden					
510	3.5	Andere Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems					
4	17	Von Artikel 2 und 3 freigestellte besicherte Finanzierungsgeschäfte					
530	4.1	Davon: besichert durch Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität					
540	4.2	Davon: besichert durch gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1					
550	4.3	Davon: besichert durch Aktiva der Stufe 2A					
560	4.4	Davon: besichert durch Aktiva der Stufe 2B					
570	4.5	Davon: besichert durch nicht liquide Aktiva					

Zeile	ID	Posten	Anwendbare Gewichtung		Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9		Zufluss	
			Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen
010	1	ZUFLÜSSE INSGESAMT						
020	1.1	Zuflüsse aus unbesicherten Geschäften/Einlagen						
030	1.1.1	Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken)						
040	1.1.1.1	Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken), die keiner Kapitalrückzahlung entsprechen						
050	1.1.1.2	Andere fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken)						
060	1.1.1.2.1	Fällige Zahlungen von Privatkunden						
070	1.1.1.2.2	Fällige Zahlungen von Nichtfinanzunternehmen						
080	1.1.1.2.3	Fällige Zahlungen von Staaten, multilateralen Entwicklungsbanken und öffentlichen Stellen						
090	1.1.1.2.4	Fällige Zahlungen von anderen juristischen Personen						
100	1.1.2	Fällige Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden						
110	1.1.2.1	Fällige Zahlungen von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind						
120	1.1.2.1.1	Fällige Zahlungen von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind, wobei das Kreditinstitut eine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln kann						

Zeile	ID	Posten	Anwendbare Gewichtung		Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9		Zufluss	
			Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse ausgenommen	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen
130	1.1.2.1.2	Fällige Zahlungen von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind, wobei das Kreditinstitut keine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln kann	080	090	100	110	120	130
140	1.1.2.2	Fällige Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden, die nicht als operative Einlagen eingestuft sind						
150	1.1.2.2.1	Fällige Zahlungen von Zentralbanken.						
160	1.1.2.2.2	Fällige Zahlungen von Finanzkunden						
170	1.1.3	Zuflüsse in Verbindung mit Abflüssen im Einklang mit Fördendarlehenszusagen gemäß Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.						
180	1.1.4	Fällige Zahlungen aus Handelsfinanzierungsgeschäften						
190	1.1.5	Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden						
201	1.1.6	Darlehen mit unbestimmtem vertraglichem Endtermin						
210	1.1.7	Fällige Zahlungen aus Positionen in Eigenkapitalinstrumenten eines wichtigen Indexes, sofern sie nicht gleichzeitig als liquide Aktiva erfasst werden						
230	1.1.8	Zuflüsse aus der Freigabe von Salden, die im Einklang mit Vorschriften für die Sicherung von Kundenhandelsaktiva auf getrennten Konten geführt werden						
240	1.1.9	Zuflüsse aus Derivaten						

Zeile	ID	Posten	Anwendbare Gewichtung		Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9		Zufuss	
			Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse
250	1.1.10	Zuflüsse aus nicht in Anspruch genommenen Kredit- bzw. Liquiditätsfazilitäten, die durch Mitglieder einer Gruppe oder eines institutsbbezogenen Sicherungssystems bereitgestellt wurden, wobei die zuständige Behörde die Anwendung einer günstigeren Zufussrate genehmigt hat	080	090	100	110	120	130
260	1.1.11	Andere Zuflüsse						
263	1.2	Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarktransaktionen						
265	1.2.1	Gegenpartei ist Zentralbank						
267	1.2.1.1	Sicherheiten, die als liquide Aktiva anerkannt werden						
269	1.2.1.1.1	Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität						
271	1.2.1.1.1.1	Davon: Empfängene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
273	1.2.1.1.2	Sicherheiten der Stufe 1 in Form gedeckter Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität						
275	1.2.1.1.2.1	Davon: Empfängene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
277	1.2.1.1.3	Sicherheiten der Stufe 2A						
279	1.2.1.1.3.1	Davon: Empfängene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
281	1.2.1.1.4	Sicherheiten in Formforderungsbewerteter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz)						
283	1.2.1.1.4.1	Davon: Empfängene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
285	1.2.1.1.5	Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B						
287	1.2.1.1.5.1	Davon: Empfängene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						

Zeile	ID	Posten	Anwendbare Gewichtung		Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9		Zufluss	
			Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen
289	1.2.1.1.6	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen)						
291	1.2.1.1.6.1	Davon: Empfangene Anforderungen	Sicherheiten	erfüllen	die operativen			
293	1.2.1.1.7	Sicherheiten der Stufe 2B, die nicht bereits in den Abschnitten 1.2.1.4., 1.2.1.5. oder 1.2.1.6. erfasst wurden						
295	1.2.1.1.7.1	Davon: Empfangene Anforderungen	Sicherheiten	erfüllen	die operativen			
297	1.2.1.2	Sicherheiten zur Deckung von Leerverkaufpositionen						
299	1.2.1.3	Sicherheiten, die nicht als liquide Aktiva anerkannt werden						
301	1.2.1.3.1	Sicherheiten sind nicht liquide Eigenmittel						
303	1.2.1.3.2	Alle anderen nicht liquiden Sicherheiten						
305	1.2.2	Gegenpartei ist keine Zentralbank						
307	1.2.2.1	Sicherheiten, die als liquide Aktiva anerkannt werden						
309	1.2.2.1.1	Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität						
311	1.2.2.1.1.1	Davon: Empfangene Anforderungen	Sicherheiten	erfüllen	die operativen			
313	1.2.2.1.2	Sicherheiten der Stufe 1 in Form gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität						
315	1.2.2.1.2.1	Davon: Empfangene Anforderungen	Sicherheiten	erfüllen	die operativen			
317	1.2.2.1.3	Sicherheiten der Stufe 2A						
319	1.2.2.1.3.1	Davon: Empfangene Anforderungen	Sicherheiten	erfüllen	die operativen			

Zeile	ID	Posten	Anwendbare Gewichtung		Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9		Zufuss	
			Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen
321	1.2.2.1.4	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz)						
323	1.2.2.1.4.1	Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
325	1.2.2.1.5	Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B						
327	1.2.2.1.5.1	Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
329	1.2.2.1.6	Sicherheiten in Formforderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen)						
331	1.2.2.1.6.1	Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
333	1.2.2.1.7	Sicherheiten der Stufe 2B, die nicht bereits in den Abschnitten 1.2.2.4., 1.2.2.5. oder 1.2.2.6. erfasst wurden						
335	1.2.2.1.7.1	Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
337	1.2.2.2	Sicherheiten zur Deckung von Leerverkaufspositionen						
339	1.2.2.3	Sicherheiten, die nicht als liquide Aktiva anerkannt werden						
341	1.2.2.3.1	Lombardgeschäfte: Sicherheiten sind nicht liquide						
343	1.2.2.3.2	Sicherheiten sind nicht liquide Eigenmittel						
345	1.2.2.3.3	Alle anderen nicht liquiden Sicherheiten						
410	1.3	Summe der Zuflüsse aus Sicherheitswaps						

Zeile	ID	Posten	Anwendbare Gewichtung				Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9	Zufluss
			Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen	Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse		
420	1.4	(Differenz zwischen der Summe der gewichteten Zuflüsse und der Summe der gewichteten Abflüsse aus Drittländern, in denen Transferbeschränkungen gelten oder die auf nichtkonvertierbare Währungen lauten)	080	090	100	110	120	130
430	1.5	(Überschüssige Zuflüsse von einem verbundenen spezialisierten Kreditinstitut)						140
ZUSATZINFORMATIONEN								
450	2	Fremdwährungszuflüsse						
460	3	Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems						
470	3.1	Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken)						
480	3.2	Fällige Zahlungen von Finanzkunden						
490	3.3	Besicherte Transaktionen						
500	3.4	Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden						
510	3.5	Andere Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems						
4	Von Artikel 17 Absätze 2 und 3 freigestellte besicherte Finanzierungsgeschäfte							
530	4.1	Davon: besichert durch Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität						
540	4.2	Davon: besichert durch gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1						
550	4.3	Davon: besichert durch Aktiva der Stufe 2A						
560	4.4	Davon: besichert durch Aktiva der Stufe 2B						
570	4.5	Davon: besichert durch nicht liquide Aktiva						

C 75.01 – LIQUIDITÄTSDECKUNG – SICHERHEITENSWAPS

Währung

Zeile	ID	Posten	Marktwert der ver- liehenen Sicher- heiten	Liquidi- tätswert der ver- liehenen Sicher- heiten	Standard- gewich- tung	Anwend- bare Gewich- tung	Zuflüsse mit der Obergren- ze von 75 % für Zuflüsse	Zuflüsse – von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenom- men				
			0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100
0010	1	SICHERHEITENSWAPS INSGESAMT (Gegenpartei ist Zentralbank)										
0020	1.1	Summe der Transaktionen, bei denen Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität) verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:										
0030	1.1.1	Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)						0,00				
0040	1.1.1.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0050	1.1.2	Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität					0,07					
0060	1.1.2.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0070	1.1.3	Aktiva der Stufe 2A					0,15					
0080	1.1.3.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0090	1.1.4	Stufe 2B:forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)							0,25			
0100	1.1.4.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0110	1.1.5	Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität								0,30		

Zeile	ID		Posten	Marktwert der ver- liehenen Sicher- heiten	Liquidifi- zierungswert der ver- liehenen Sicher- heiten	Markt- wert der gelehenen Sicher- heiten	Liquidati- tätswert der gleich- en Sicher- heiten	Standard- gewich- tung	Anwend- bare Gewich- tung	Zuflüsse mit der Obergren- ze von Zuflüsse	Zuflüsse— von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenom- men	
0580	14.3	Aktiva der Stufe 2A		0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090
0590	14.3.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						0,00				
0600	14.4	Stufe 2B:forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)						0,00				
0610	14.4.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0620	14.5	Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität						0,05				
0630	14.5.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0640	14.6	Stufe 2B:forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)						0,10				
0650	14.6.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0660	14.7	Andere Aktiva der Stufe 2B						0,25				
0670	14.7.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0680	14.8	Nicht liquide Aktiva						0,75				
0690	14.8.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0700	1.5	Summe der Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B verliehen und folgende Sicherheiten geliefert wurden:										
0710	1.5.1	Aktivader Stufel 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)							0,00			
0720	1.5.1.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0730	1.5.2	Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität							0,00			

Zeile	ID	Posten	Marktwert der verliehenen Sicherheiten	Marktwert der verliehenen Sicherheiten	Liquiditätswert der verliehenen Sicherheiten	Anwendbare Gewichtung	Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse
1640	2.2.5	Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität					
1650	2.2.5.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
1660	2.2.6	Stufe 2B:forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)					
1670	2.2.6.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
1680	2.2.7	Andere Aktiva der Stufe 2B					
1690	2.2.7.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
1700	2.2.8	Nicht liquide Aktiva					
1710	2.2.8.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
1720	2.3	Summe der Transaktionen, bei denen Aktiva der Stufe 2A verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:					
1730	2.3.1	Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität)					
1740	2.3.1.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
1750	2.3.2	Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität					
1760	2.3.2.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
1770	2.3.3	Aktiva der Stufe 2A					
1780	2.3.3.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					

Zeile	ID	Posten	Marktwert der verliehenen Sicherheiten	Marktwert der verliehenen Sicherheiten	Liquiditätswert der verliehenen Sicherheiten	Anwendbare Gewichtung	Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse
1920	2.4.2	Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität					
1930	2.4.2.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
1940	2.4.3	Aktiva der Stufe 2A				0,10	
1950	2.4.3.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
1960	2.4.4	Stufe 2B:forderungsbescicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)				0,00	
1970	2.4.4.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
1980	2.4.5	Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität				0,05	
1990	2.4.5.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
2000	2.4.6	Stufe 2B:forderungsbescicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)				0,10	
2010	2.4.6.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
2020	2.4.7	Andere Aktiva der Stufe 2B				0,25	
2030	2.4.7.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
2040	2.4.8	Nicht liquide Aktiva				0,75	
2050	2.4.8.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					
2060	2.5	Summe der Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B verliehen und folgende Sicherheiten geleihen wurden:					
2070	2.5.1	Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)					0,30
2080	2.5.1.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen					

Zeile	ID	Posten	Marktwert der ver- liehenen Sicher- heiten	Liquiditätswert der ver- liehenen Sicher- heiten	Markt- wert der gelehenen Sicher- heiten	Liquiditätswert der geliehenen Sicher- heiten	Anwend- bare Gewich- tung	Zuflüsse mit der Obergren- ze von Zuflüsse	Zuflüsse— von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenom- men
2380	2.6.8	Nicht liquide Aktiva							
2390	2.6.8.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
2400	2.7	Summe der Transaktionen, bei denen andere Aktiva der Stufe 2B verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:							
2410	2.7.1	Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität)						0,50	
2420	2.7.1.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
2430	2.7.2	Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität						0,43	
2440	2.7.2.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
2450	2.7.3	Aktiva der Stufe 2A						0,35	
2460	2.7.3.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
2470	2.7.4	Stufe 2B:forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)						0,25	
2480	2.7.4.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
2490	2.7.5	Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität						0,20	
2500	2.7.5.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							
2510	2.7.6	Stufe 2B:forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)						0,15	
2520	2.7.6.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							

C 76.00 – LIQUIDITÄTSDECKUNG – BERECHNUNGEN

			Währung	
Zeile	ID		Posten	Wert/Prozentsatz
BERECHNUNGEN				
Zähler, Nenner, Verhältnis				
010	1	Liquiditätspuffer		010
020	2	Netto-Liquiditätsabfluss		
030	3	Liquiditätsdeckungsquote (%)		
Berechnungen des Zählers				
040	4	Liquiditätspuffer der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität (Wert gemäß Artikel 9); unbereinigt		
050	5	Abflüsse der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden		
060	6	Zuflüsse der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden		
070	7	Besicherte Liquiditätsabflüsse, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden		
080	8	Besicherte Liquiditätszuflüsse, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden		
091	9	Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität: „bereinigter Betrag“		
100	10	Wert von gedeckten Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität der Stufe 1 gemäß Artikel 9; unbereinigt		
110	11	Abflüsse aus gedeckten Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität der Stufe 1, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden		
120	12	Zuflüsse aus gedeckten Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität der Stufe 1, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden		
131	13	gedeckte Schuldverschreibungen außerst hoher Qualität der Stufe 1: „bereinigter Betrag“		
160	14	Wert von Aktiva der Stufe 2A gemäß Artikel 9: unbereinigt		

Zeile	ID	Posten	Wert/Prozentsatz
			010
170	15	Abflüsse aus Sicherheiten der Stufe 2A, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden	
180	16	Zuflüsse aus Sicherheiten der Stufe 2A, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden	
191	17	Aktiva der Stufe 2A; ,bereinigter Betrag'	
220	18	Wert von Aktiva der Stufe 2B gemäß Artikel 9: unbereinigt	
230	19	Abflüsse aus Sicherheiten der Stufe 2B, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden	
240	20	Zuflüsse aus Sicherheiten der Stufe 2B, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden	
251	21	Aktiva der Stufe 2B; ,bereinigter Betrag'	
280	22	Betrag der überschüssigen liquiden Aktiva	
290	23	Liquiditätspuffer	
Berechnungen des Nenners			
300	24	Gesamtabflüsse	
310	25	Vollständig ausgenommene Zuflüsse	
320	26	Zuflüsse mit der Obergrenze von 90 %	
330	27	Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 %	
340	28	Abschläge für vollständig ausgenommene Zuflüsse	
350	29	Abschläge für Zuflüsse mit der Obergrenze von 90 %	
360	30	Abschläge für Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 %	
370	31	Netto-Liquiditätsabfluss	
Säule 2			
380	32	Anforderung nach Säule 2 gemäß Artikel 105 der Eigenmittelrichtlinie	

C 77.00 — LIQUIDITÄTSDECKUNG — KONSOLIDIERUNGSKREIS

Mutter- oder Tochterunternehmen	Name	Code	Unternehmens- kennung (LEI)	Ländercode	Art des Unternehmens
005	010	020	030	040	050
					“