

„ANHANG XXIV  
LIQUIDITÄTSMELDUNGEN

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

C 72.00 — LIQUIDITÄTSDECKUNG — LIQUIDE AKTIVA									
Zeile	ID	Posten	Währung	Betrag/ Marktwert 010	Standard- gewichtung 020	Anwendbare Gewichtung 030	Wert gemäß Artikel 9 040		
010	1	<b>SUMME DER UNBEREINIGTEN LIQUIDEN AKTIVA</b>							
020	1.1	<b>Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 1</b>							
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	
						010	040
150	1.1.1.1.2	Alternative Liquiditätsansätze: Kreditfazilität einer Zentralbank		1,00	030	040	
160	1.1.1.1.3	Zentralinstitute: Aktiva der Stufe 1 ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, die als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden					
170	1.1.1.1.4	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	<b>Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 2</b>					
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	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	Forderungbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien, Bonitätsstufe 1)		0,75			
330	1.2.2.2	Forderungbesicherte Wertpapiere (Kfz, Bonitätsstufe 1)		0,75			
340	1.2.2.3	Gedekte Schuldverschreibungen hoher Qualität (Risikogewicht 35 %)		0,70			
350	1.2.2.4	Forderungbesicherte 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 mit forderungbesicherten 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 mit forderungbesicherten Wertpapieren als zugrunde liegende Aktiva (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)		0,60			

Zeile	ID	Posten	Betrag/ Marktwert	Standard- gewichtung	Anwendbare Gewichtung	Wert gemäß Artikel 9	
						010	030
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		040	040
450	1.2.2.14	Einlagen von Verbundmitgliedern bei Zentralinstituten (keine Pflichtinvestition)		0,75			
460	1.2.2.15	Liquiditätsfinanzierung für Verbundmitglieder durch das Zentralinstitut (nicht festgelegte Besicherung)		0,75			
470	1.2.2.16	Zentralinstitute: Aktiva der Stufe 2B, die als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden					
<b>ZUSATZINFORMATIONEN</b>							
485	2	<b>Einlagen von Verbundmitgliedern bei Zentralinstituten (Pflichtinvestition)</b>					
580	3	<b>Aktiva der Stufen 1/2A/2B, die aus Währungsgründen ausgeschlossen werden</b>					
590	4	<b>Aktiva der Stufen 1/2A/2B, die aus operativen Gründen, ausgenommen Währungsgründe, ausgeschlossen werden</b>					

**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	<b>1</b>	<b>ABFLÜSSE</b>	010	020	030	040	050	060
020	<b>1.1</b>	<b>Abflüsse aus unbesicherten Geschäften/Einlagen</b>						
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 angewandeter 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-, Gelddispositions- 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
			010	020	030	040	050	060
160	1.1.2.2	In einem institutsbezogenen Sicherungssystem oder Genossenschaftsverband gehalten						
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 Zahlungsverkehrsabrechnung (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	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
			010	020	030	040	050	060
270	1.1.5	Zusätzliche Abflüsse						
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	Leerverkaufspositionen						
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	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
			010	020	030	040	050	060
470	1.1.6.1	Kreditfazilitäten						
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						
590	1.1.6.2.1	Für Privatkunden				0,05		
600	1.1.6.2.2	Für andere Nichtfinanzkunden als Privatkunden				0,30		
610	1.1.6.2.3	Für private Beteiligungsgesellschaften				0,40		
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
			010	020	030	040	050	060
630	1.1.6.2.4.1	Für den Erwerb anderer Vermögenswerte als Wertpapiere von Nichtfinanzkunden				0,10		
640	1.1.6.2.4.2	Sonstiges				1,00		
650	1.1.6.2.5	Für Kreditinstitute						
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 Genossenschaftsverbund, 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	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
			010	020	030	040	050	060
850	1.1.7.7	Derivateverbindlichkeiten						
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 Schulverschreibungen, 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	<b>1.2</b>	<b>Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen</b>						
930	1.2.1	Gegenpartei ist Zentralbank						
940	1.2.1.1	Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schulverschreibungen 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
			010	020	030	040	050	060
950	1.2.1.2	Sicherheiten der Stufe 1 in Form von Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität				0,00		
955	1.2.1.2.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
960	1.2.1.3	Sicherheiten der Stufe 2A				0,00		
965	1.2.1.3.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
970	1.2.1.4	Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)				0,00		
975	1.2.1.4.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
980	1.2.1.5	Gedekte Schuldverschreibungen der Stufe 2B				0,00		
985	1.2.1.5.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
990	1.2.1.6	Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedsstaat, Bonitätsstufe 1)				0,00		
995	1.2.1.6.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
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 gedekte 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	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
			010	020	030	040	050	060
1040	1.2.2.2	Sicherheiten der Stufe 1 in Form von Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität				0,07		
1045	1.2.2.2.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1050	1.2.2.3	Sicherheiten der Stufe 2A				0,15		
1055	1.2.2.3.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1060	1.2.2.4	Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)				0,25		
1065	1.2.2.4.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1070	1.2.2.5	Gedekte Schuldverschreibungen der Stufe 2B				0,30		
1075	1.2.2.5.1	Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1080	1.2.2.6	Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)				0,35		
1085	1.2.2.6.1	Davon: Ausgereichte 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: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen						
1100	1.2.2.8	Sicherheiten in Form nicht liquider Aktiva				1,00		
1130	<b>1.3</b>	<b>Summe der Abflüsse aus Sicherheiten-swaps</b>						

Zeile	ID	Posten	Betrag	Marktwert der ausgereichten Sicherheiten	Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
			010	020	030	040	050	060
<b>ZUSATZINFORMATIONEN</b>								
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	<b>Abflüsse innerhalb gruppeninterner und institutsinterner Sicherungssysteme</b>						
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	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abfluss
			010	020	030	040	050	060
1360	4.9	Davon: Verbindlichkeiten in Form von Schuldverschreibungen, sofern nicht als Privatkundeneinlagen behandelt						
1370	5	<b>Fremdwährungsabflüsse</b>						
	6	<b>Von Artikel 17 Absätze 2 und 3 freigestellte besicherte Finanzierung</b>						
1400	6.1	Davon: besichert durch Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität						
1410	6.2	Davon: besichert durch gedeckte Schuldverschreibungen äußerst 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 75.01 — LIQUIDITÄTSDECKUNG — SICHERHEITENSWAPS

Währung

Zeile	ID	Posten	Marktwert der verlehnten Sicherheiten	Liquiditätswert der verlehnten Sicherheiten	Marktwert der geliehenen Sicherheiten	Liquiditätswert der geliehenen Sicherheiten	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abflüsse	Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Zuflüsse mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Zuflüsse — von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen
			0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100
0010	1	SICHERHEITENSWAPS INSGESAMT (Gegenpartei ist Zentralbank)					0050	0060	0070	0080	0090	0100
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	Aktiv 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	Liquiditätswert der ver- liehenen Sicher- heiten	Markt- wert der geliehenen Sicher- heiten	Liquiditätswert der geliehenen Sicher- heiten	Standard- gewich- tung	Anwend- bare Gewich- tung	Abflüsse	Zuflüsse mit der Obergren- ze von 75 % für Zuflüsse	Zuflüsse mit der Obergren- ze von 90 % für Zuflüsse	Zuflüsse— von der Obergrenze für Zuflüsse für ausgenom- men
0120	1.1.5.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen							0070	0080	0090	0100
0130	1.1.6	Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)					0,35					
0140	1.1.6.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0150	1.1.7	Andere Aktiva der Stufe 2B					0,50					
0160	1.1.7.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0170	1.1.8	Nicht liquide Aktiva					1,00					
0180	1.1.8.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0190	1.2	<b>Summe der Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</b>										
0200	1.2.1	Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)					0,00					
0210	1.2.1.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0220	1.2.2	Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität					0,00					
0230	1.2.2.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0240	1.2.3	Aktiva der Stufe 2A					0,08					
0250	1.2.3.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0260	1.2.4	Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)					0,18					





Zeile	ID	Posten	Marktwert der verliehenen Sicherheiten	Liquiditätswert der verliehenen Sicherheiten	Marktwert der geliehenen Sicherheiten	Liquiditätswert der geliehenen Sicherheiten	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abflüsse	Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Zuflüsse mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Zuflüsse — von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen
			0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100
0580	1.4.3	Aktiva der Stufe 2A					0,00					
0590	1.4.3.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0600	1.4.4	Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)					0,00					
0610	1.4.4.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0620	1.4.5	Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität					0,05					
0630	1.4.5.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0640	1.4.6	Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)					0,10					
0650	1.4.6.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0660	1.4.7	Andere Aktiva der Stufe 2B					0,25					
0670	1.4.7.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0680	1.4.8	Nicht liquide Aktiva					0,75					
0690	1.4.8.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0700	1.5	<b>Summe der Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</b>										
0710	1.5.1	Aktiva der Stufe 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					



Zelle	ID	Posten	Marktwert der verlehlenen Sicherheiten	Liquiditätswert der verlehlenen Sicherheiten	Marktwert der geliehenen Sicherheiten	Liquiditätswert der geliehenen Sicherheiten	Standardgewichtung	Anwendbare Gewichtung	Abflüsse	Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse	Zuflüsse mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse	Zuflüsse — von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen
			0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100
0740	1.5.2.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0750	1.5.3	Aktiva der Stufe 2A					0,00					
0760	1.5.3.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0770	1.5.4	Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)					0,00					
0780	1.5.4.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0790	1.5.5	Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität					0,00					
0800	1.5.5.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0810	1.5.6	Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)					0,05					
0820	1.5.6.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0830	1.5.7	Andere Aktiva der Stufe 2B					0,20					
0840	1.5.7.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0850	1.5.8	Nicht liquide Aktiva					0,70					
0860	1.5.8.1	Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen										
0870	1.6	<b>Summe der Transaktionen, bei denen forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</b>										
0880	1.6.1	Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)					0,00					





























C 76.00 — LIQUIDITÄTSDECKUNG — BERECHNUNGEN		
	Währung	
Zeile	ID	Posten
		Wert/Prozentsatz
		010
<b>BERECHNUNGEN</b>		
<b>Zähler, Nenner, Verhältnis</b>		
010	1	Liquiditätspuffer
020	2	Netto-Liquiditätsabfluss
030	3	Liquiditätsdeckungsquote (%)
<b>Berechnungen des Zählers</b>		
040	4	Liquiditätspuffer der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität (Wert gemäß Artikel 9): unbereinigt
050	5	Abflüsse der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden
060	6	Zuflüsse der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst 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 äußerst hoher Qualität: ‚bereinigter Betrag‘
100	10	Wert von gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 gemäß Artikel 9: unbereinigt
110	11	Abflüsse aus gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden
120	12	Zuflüsse aus gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden
131	13	gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1: ‚bereinigter Betrag‘
160	14	Wert von Aktiva der Stufe 2A gemäß Artikel 9: unbereinigt

Zeile		ID	Posten	Wert/Prozentsatz
170	15		Abflüsse aus Sicherheiten der Stufe 2A, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden	010
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	
<b>Berechnungen des Nenners</b>				
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	
<b>Säule 2</b>				
380	32		Anforderung nach Säule 2 gemäß Artikel 105 der Eigenmittelrichtlinie	



**C 77.00 — LIQUIDITÄTSDECKUNG — KONSOLIDIERUNGSKREIS**

<b>Mutter- oder Tochterunternehmen</b>	<b>Name</b>	<b>Code</b>	<b>Unternehmenskennung (LEI)</b>	<b>Ländercode</b>	<b>Art des Unternehmens</b>
005	010	020	030	040	050
					“