

Anlage A1

Ordnungsnormenausweis für Kreditinstitute gemäß § 1 ONA-V

Kapitel "Kapitaladäquanzblatt (CA-TEMPLATE)" gemäß § 22 BWG Eigenmittelerfordernis und § 23 BWG Eigenmittel

Periodizität: Monatlich

CA-TEMPLATE unkonsolidiert

		Betrag
1	Eigenmittel insgesamt	7800000
1.1	Kernkapital	7810000
1.1.1	Zwischensumme Kapitalia	7811000
1.1.1*	hievon begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kernkapitalinstrumente	7811002
1.1.1**	hievon begrenzt anrechenbare, innovative Kernkapitalinstrumente	7811004
1.1.1.1	Eingezahltes Kapital (Geschäfts-, Grund-, Stamm-, Dotationskapital und Geschäftsguthaben) ohne Vorzugsaktien mit Dividendennachzahlungspflicht	7811006
1.1.1.2	(-) Eigene Aktien oder Geschäftsanteile	7811008
1.1.1.3	Kapitalrücklage (Emissionsagiokonto)	7811010
1.1.1.4	Sonstige als eingezahltes Kapital anrechenbare Instrumente (z.B. unbefristete stille Beteiligungen)	7811012
1.1.2	Sonstige anrechenbare Rücklagen	7812000
1.1.2*	hievon Haftrücklage	7812003
1.1.2.1	Sonstige Rücklagen	7812006
1.1.2.2	Minderheitsbeteiligungen	7812009
1.1.2.2*	hievon begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kapitalinstrumente	7812012
1.1.2.2**	hievon begrenzt anrechenbare, innovative Kapitalinstrumente	7812015
1.1.2.3	Zwischengewinn	7812018
1.1.2.4	(-) Bilanzverlust sowie materielle negative Ergebnisse im laufenden Geschäftsjahr	7812021
1.1.2.5	(-) Nettogewinne aus der Kapitalisierung künftiger Erträge verbriefter Forderungen	7812024
1.1.2.6	Im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften (Prudential Filters)	7812027
1.1.2.6.01	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten	7812030
1.1.2.6.02	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten	7812033
1.1.2.6.03	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Krediten und sonstigen Forderungen	7812036
1.1.2.6.04	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Krediten und sonstigen Forderungen	7812039
1.1.2.6.05	Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögensgegenständen	7812042
1.1.2.6.06	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögensgegenständen	7812045
1.1.2.6.07	Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf Finanzinstrumente (eigenes Kreditrisiko)	7812048
1.1.2.6.08	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf Finanzinstrumente (eigenes Kreditrisiko)	7812051
1.1.2.6.09	Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögensgegenständen dienen	7812054
1.1.2.6.10	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögensgegenständen dienen	7812057
1.1.2.6.11	Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien	7812060
1.1.2.6.12	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien	7812063
1.1.2.6.13	Bewertungseffekte aus selbstgenutztem Anlagevermögen	7812066
1.1.2.6.14	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbstgenutztem Anlagevermögen	7812069
1.1.2.6.15	Andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen	7812072
1.1.2.6.16	Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen	7812075
1.1.2.6.17	+/- Unterschiedsbetrag aus der Zusammenfassung von Eigenkapital und Beteiligungen	7812078
1.1.2.6.18	+/- Umrechnungsdifferenzen ausländischer Währungen	7812081
1.1.2.6.19	+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung der nachgeordneten Institute	7812084
1.1.2.6.20	+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung von Beteiligungen an Unternehmen	7812087
1.1.3	Fonds für allgemeine Bankrisiken	7813000
1.1.4	Andere, landesspezifische Kernkapitalbestandteile	7814000
1.1.4.1	Begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kernkapitalinstrumente	7814002

1.1.4.2	<i>Begrenzt anrechenbare, innovative Kernkapitalinstrumente</i>	7814004
1.1.4.3	<i>Korrekturposten (positiv) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften</i>	7814006
1.1.4.4	<i>Sonstige Korrekturposten (positiv)</i>	7814008
1.1.5	(-) Sonstige Abzugspositionen vom Kernkapital	7815000
1.1.5.1	<i>(-) Immaterielle Vermögensgegenstände</i>	7815002
1.1.5.2	<i>(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze nicht innovativer Kernkapitalinstrumente (> 50% des Kernkapitals)</i>	7815004
1.1.5.3	<i>(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze innovativer Kernkapitalinstrumente (> 15% oder 30% des Kernkapitals gemäß § 24 Abs. 2 Z 1 BWG)</i>	7815006
1.1.5.4	<i>(-) Andere, landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital</i>	7815008
1.1.5.4.1	<i>(-) Korrekturposten (negativ) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften</i>	7815010
1.1.5.4.2	<i>(-) Sonstige Korrekturposten (negativ)</i>	7815012
1.2	Ergänzende Eigenmittel	7820000
1.2.1	Zwischensumme I	7821000
1.2.1.1	<i>Als ergänzende Eigenmittel anrechenbare Kernkapitalbestandteile</i>	7821005
1.2.1.2	<i>Korrekturposten für aus dem Kernkapital übertragene Bewertungseffekte (Prudential Filters)</i>	7821010
1.2.1.2.01	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten</i>	7821015
1.2.1.2.02	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Vermögensgegenständen umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821020
1.2.1.2.03	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821025
1.2.1.2.04	<i>Korrekturposten aus selbstgenutztem Anlagevermögen umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821030
1.2.1.2.05	<i>Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen</i>	7821035
1.2.1.3	<i>Anrechenbare nicht realisierte Reserven in Grundstücken, grundstücksgleichen Rechten und Gebäuden sowie in notierten Wertpapieren in Verbundunternehmen und Gebäuden (Neubewertungsreserve)</i>	7821040
1.2.1.4	<i>Sonstige ergänzende Eigenmittelkomponenten/Ergänzungskapital gemäß § 23 Abs. 1 Z 5 BWG</i>	7821045
1.2.1.5	<i>Berücksichtigungsfähiger Risikovorsorgeüberschuss für IRB-Positionen</i>	7821050
1.2.1.6	<i>Landesspezifische ergänzende Eigenmittelbestandteile höherer Qualität</i>	7821055
1.2.1.6.1	<i>Stille Reserven</i>	7821060
1.2.1.6.2	<i>Partizipationskapital mit Dividendennachzahlungspflicht</i>	7821065
1.2.1.7	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 4 BWG</i>	7821070
1.2.2	Zwischensumme II	7822000
1.2.2.1	<i>Haftsummenzuschläge</i>	7822005
1.2.2.2	<i>Kumulative Vorzugsaktien mit fester Laufzeit</i>	7822010
1.2.2.3	<i>Langfristiges nachrangiges Kapital</i>	7822015
1.2.2.4	<i>Landesspezifische ergänzende Eigenmittelbestandteile niedriger Qualität</i>	7822020
1.2.2.5	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 3 BWG</i>	7822025
1.2.2.6	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 6 BWG</i>	7822030
1.2.3	(-) Abzugspositionen von der Summe der ergänzenden Eigenmittel	7823000
1.2.3.1	<i>(-) Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 2 BWG</i>	7823005
1.2.3.2	<i>(-) Andere, landesspezifische Abzugspositionen von der Summe der ergänzenden Eigenmittel</i>	7823010
1.3	(-) Abzugspositionen vom Kernkapital und von ergänzenden Eigenmittel	7830000
1.3.T1*	<i>hievon (-) vom Kernkapital</i>	7830002
1.3.T2*	<i>hievon (-) von ergänzenden Eigenmittel</i>	7830004
1.3.1	(-) Anteile an anderen Kredit- und Finanzinstituten von mehr als 10% ihres Kapitals	7830006
1.3.2	(-) Nachrangige Forderungen, Partizipationskapital, Ergänzungskapital oder sonstige Kapitalformen, die das Kreditinstitut an anderen Kredit- und Finanzinstituten hält, an deren Kapital es zu jeweils mehr als 10% beteiligt ist	7830008
1.3.3	(-) Kapitalbestandteile an anderen als unter 1.3.1 und 1.3.2 genannten Kredit- und Finanzinstituten von höchstens 10% ihres Kapitals, sofern diese zusammengekommen mehr als 10% der Eigenmittel des Kreditinstitutes übersteigen	7830010
1.3.4	(-) Beteiligungen an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften	7830012
1.3.5	(-) Sonstige Kapitalbestandteile an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften	7830014
1.3.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital und von ergänzenden Eigenmittel	7830016

1.3.7	(-) Verbriefungspositionen, auf die ein Risikogewicht von 1250% angewandt wird und die bei der Ermittlung der risikogewichteten Aktiva nicht berücksichtigt worden sind	7830018
1.3.8	(-) Risikovorsorge-Fehlbeträge für IRB-Positionen	7830020
1.4	<i>Anrechenbares Kernkapital (nach Abzugsposten)</i>	7810001
1.5	<i>Anrechenbare ergänzende Eigenmittel (nach Abzugsposten)</i>	7830001
1.6	Anrechenbares Kernkapital und anrechenbare ergänzende Eigenmittel (nach Abzugsposten)	7850001
1.7	<i>Tier III-Kapital</i>	7840000
1.7.1	Zur Umwidmung in Tier III-Kapital zur Verfügung stehendes Tier II-Kapital	7840005
1.7.2	Nettogewinn aus dem Handelsbuch	7840010
1.7.3	Kurzfristiges nachrangiges Kapital	7840015
1.7.4	(-) Illiquide Aktiva	7840020
1.7.5	Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 7 BWG	7840025
1.7.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Tier III-Kapital	7840030
1.7.7	(-) Ungenutztes, aber anrechenbares Tier III-Kapital	7840035
1.8	ZUSATZINFORMATIONEN:	
1.8.1	<i>Auf interne Ratings basierender Ansatz-Risikovorsorgen Überschuss (+)/Fehlbetrag (-)</i>	7850015
1.8.1.1	<i>Höhe der IRB-Risikovorsorgen</i>	7850020
1.8.1.1*	<i>hievon Pauschalwertberichtigungen</i>	7850025
1.8.1.1**	<i>Einzelwertberichtigungen</i>	7850030
1.8.1.1***	<i>Rückstellungen</i>	7850035
1.8.1.2	<i>(-) IRB-Ermittlung des erwarteten Verlustes</i>	7850040
1.8.2	Vorhandene Nachrangkapitalia gemäß § 23 Abs. 14 Z 5 BWG	7850045
1.9	<i>Wert des Fondsvermögens gemäß § 3 Abs. 4 BWG</i>	7850050
1.10	<i>Eigenmittel-Basis für Großveranlagungen gemäß § 27 BWG</i>	7850055
2	Gesamteigenmittelerfordernis	7700000
2.1	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Kreditrisiko gemäß §§ 22a bis 22h BWG	7710000
2.1*	<i>hievon Kontrahentenausfallsrisiko aus dem Handelsbuch</i>	7710001
2.1.1	Standardansatz (SA)	7711000
2.1.1.1a	Standardansatz-Forderungsklassen (ohne Berücksichtigung von Verbriefungspositionen)	7711003
2.1.1.1a.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7711006
2.1.1.1a.02	Forderungen an regionale Gebietskörperschaften	7711009
2.1.1.1a.03	Forderungen an Verwaltungseinrichtungen und Unternehmen ohne Erwerbscharakter im Besitz von Gebietskörperschaften	7711012
2.1.1.1a.04	Forderungen an multilaterale Entwicklungsbanken	7711015
2.1.1.1a.05	Forderungen an internationale Organisationen	7711018
2.1.1.1a.06	Forderungen an Institute	7711021
2.1.1.1a.07	Forderungen an Unternehmen	7711024
2.1.1.1a.08	Retail-Forderungen	7711027
2.1.1.1a.09	Durch Immobilien besicherte Forderungen	7711030
2.1.1.1a.10	Überfällige Forderungen	7711033
2.1.1.1a.11	Forderungen mit hohem Risiko	7711036
2.1.1.1a.12	Forderungen in Form von gedeckten Schuldverschreibungen	7711039
2.1.1.1a.13	Kurzfristige Forderungen an Institute und Unternehmen	7711042
2.1.1.1a.14	Forderungen in Form von Investmentfondsanteilen	7711045
2.1.1.1a.15	Sonstige Posten	7711048
2.1.1.2	Verbriefungspositionen - Standardansatz	7711060
2.1.2	Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRB)	7712000
2.1.2.1	Auf interne Ratings basierender Ansatz - ohne eigene LGD-Schätzung/Anwendung von Umrechnungsfaktoren	7712005
2.1.2.1.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7712010
2.1.2.1.02	Forderungen an Institute	7712015
2.1.2.1.03	Forderungen an Unternehmen	7712020
2.1.2.2	IRB-Ansatz - mit eigenr LGD-Schätzung/Anwendung von Umrechnungsfaktoren	7712025
2.1.2.2.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7712030
2.1.2.2.02	Forderungen an Institute	7712035
2.1.2.2.03	Forderungen an Unternehmen	7712040
2.1.2.2.04	Retail-Forderungen	7712045
2.1.2.3	Beteiligungspositionen IRB	7712050
2.1.2.4	Verbriefungspositionen IRB	7712055

2.1.2.5	<i>Sonstige Forderungen</i>	7712060
2.2	ABWICKLUNGSRISIKO	7720000
2.3	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko	7730000
2.3.1	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko (Standardansatz)	7731000
2.3.1.a	hievon nicht-lineare Risiken	7731005
2.3.1.b	hievon Szenario-Matrixmethode gemäß § 22e Abs. 3 BWG	7731010
2.3.1.1	<i>Positionsrisiko in Schuldtiteln</i>	7731015
2.3.1.2	<i>Positionsrisiko in Substanzwerte</i>	7731020
2.3.1.3	<i>Risiko in Fremdwährungspositionen</i>	7731025
2.3.1.4	<i>Risiko in Warenpositionen</i>	7731030
2.3.2	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko (Internes Modell)	7732000
2.4	EIGENMITTELERFORDERNIS für Operationelles Risiko	7740000
2.4.1	Operationelles Risiko Basisindikatoransatz	7741000
2.4.2	Operationelles Risiko Standardansatz/Alternativer Standardansatz	7742000
2.4.3	Operationelles Risiko Fortgeschrittener Messansatz	7743000
2.5	EIGENMITTELERFORDERNISSE resultierend aus dem Umstieg auf Basel II-Bestimmungen und sonstige Eigenmittelerfordernisse	7750000
2.5.1	Erfordernis aus Mindesteigenmitteluntergrenze aus dem Umstieg auf Basel II (Floor)	7751000
2.5.2	Eigenmittelerfordernis für qualifizierte Nichtfinanzbeteiligungen	7751005
2.5.3	Zusätzliches Eigenmittelerfordernis gemäß § 3 Abs. 4 BWG – (nur von KAG zu melden)	7751010
2.5.4.	Gesamteigenmittelerfordernis bei Anwendung von § 103e Z 7 BWG im Rahmen des Roll-out gemäß 21a Abs. 7 BWG	7751015
3	ZUSATZINFORMATIONEN:	
3.1	Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln (vor Berücksichtigung sonstiger Eigenmittelerfordernisse resultierend aus dem Umstieg auf die Basel II-Bestimmungen)	7610000
3.1.a	Capital ratio (in %); (vor Berücksichtigung sonstiger Eigenmittelerfordernisse resultierend aus dem Umstieg auf die Basel II-Bestimmungen)	7610005
3.2	Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln	7620000
3.2.a	Capital ratio (in %)	7620005
3.3	Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln unter Berücksichtigung des aufsichtlichen Überprüfungsprozesses	7630000
3.3.a	Capital index ratio (in %) unter Berücksichtigung des aufsichtlichen Überprüfungsprozesses	7630005
3.4	Interne Bewertung Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln	7640000
3.4.1	Interne Bewertung der anrechenbaren Eigenmittel	7641000
3.4.2	Interne Bewertung des Eigenmittelerfordernisses	7642000

EIGENMITTELVERWENDUNGSRECHNUNG

Eigenmittelkategorien	Freies Kapital (abzüglich Eigenmittelerfordernisse gemäß § 22 Abs. 1 Z 1 BWG, § 29 Abs. 4 BWG und § 3 Abs. 4 BWG)	Freies Kapital nach Operationellem Risiko	Freies Kapital nach Abdeckung sämtlicher Eigenmittelerfordernisse
Kernkapital (Tier I-Kapital)	7951001	7961001	7971001
Ergänzende Eigenmittel (Tier II-Kapital)	7955001	7965001	7975001
Kurzfristiges nachrangiges Kapital (Tier III-Kapital)			
Summe	7950000	7960000	7970000

Kapitel "Kreditrisiko-Standardansatz"

Periodizität: Vierteljährlich

KREDITRISIKO-STANDARDSATZ

KREDITRISIKO-STANDARDSATZ

TEIL A

SA Forderungsklasse:

< ... >

TEIL B

	Bruttoforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsfaktoren		Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nettoforderung	Kreditrisikominimierende Techniken mit Substitutionseffekten						Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditrisikominimierende Techniken	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen, ausgenommen andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen; Finanzielle Sicherheiten bei Anwendung der umfassenden Methode			Angepasser Wert der Forderung (E*)	Aufgliederung des vollständig angepassten Forderungswertes bei außerbilanziellen Geschäften durch Umrechnungsfaktoren (Credit Conversion Factors, CF)				Forderungswert	Risikogewichteter Forderungswert	Eigenmittelerfordernis
					Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen (Ga)		Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen		Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikominimierenden Techniken			Volatilitätsanpassung des Forderungswertes (He)	Angepasser Wert der finanziellen Sicherheit (Cvam) (i)	Volatilitäts- und Laufzeitanpassungen (j)		0%	20%	50%	100%			
	Garantien	Kreditderivate			Finanzielle Sicherheiten	Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen	Abflüsse (-)	Zuflüsse (+)														
									1	2												
	Summe Forderungen	7701000	7702000	7703000	7704000	7705000	7706000	7707000	7708000	7709000	7710000	7712001	7713000	7714000	7715000	7716000	7717000	7718000	7719000	7724000	7721000	7722000

Aufgliederung der Summenposition nach Forderungskategorien

Bilanzielle Forderungen	7701005																			7721005	7722005	
Außerbilanzielle Forderungen	7701010																			7721010	7722010	
Lombardgeschäfte und Geschäfte mit langer Abwicklungsfrist	7701015																			7721015	7722015	
Derivate	7701020																			7721020	7722020	
Produktübergreifende Netting-Vereinbarung	7701025																			7721025	7722025	

Aufgliederung der Summenposition nach Risikogewichten

0%	7701030		7703030	7704030		7716030		7721030	7722030	7711030
10%	7701035		7703035	7704035		7716035		7721035	7722035	7711035
20%	7701040		7703040	7704040		7716040		7721040	7722040	7711040
35%	7701045		7703045	7704045		7716045		7721045	7722045	7711045
50%	7701050		7703050	7704050		7716050		7721050	7722050	7711050
ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
hypothekarisch besichert (Gewerbliche Immobilien)	7701060		7703060	7704060		7716060		7721060	7722060	7711061
75%	7701065		7703065	7704065		7716065		7721065	7722065	7711065
100%	7701070		7703070	7704070		7716070		7721070	7722070	7711070
ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur										
hypothekarisch besichert (Gewerbliche Immobilien)	7701080		7703080	7704080		7716080		7721080	7722080	7711080
150%	7701085		7703085	7704085		7716085		7721085	7722085	7711085
200%	7701089		7703089	7704089		7716089		7721089	7722089	7711089
Andere Risikogewichte nach nationalem Ermessen	7701095		7703095	7704095		7716095		7721095	7722095	7711095

KREDITRISIKO-STANDARDANSATZ (für Melde-KI, die unter dem Schwellenwert liegen) ¹⁾											KREDITRISIKO-STANDARDANSATZ (für Melde-KI, die unter dem Schwellenwert liegen) ¹⁾												
TEIL A					TEIL B																		
SA Forderungsklasse:					< ... >																		
	Bruttoforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsklassen		Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nettoforderung	Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten						Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditrisikomindernde Techniken	Kreditrisikomindernde Techniken in Form von Sicherheiten mit Sicherheitenleistungen, ausgenommen andere Formen der Besicherung mit Sicherheitenleistungen; Finanzielle Sicherheiten bei Anwendung der umfassenden Methode			Angepasster Wert der Forderung (E ¹⁾)	Aufgliederung des angepassten Forderungswertes bei außerplanmäßigen Geschäften durch Umrechnungsklassen (Credit Conversion Factors, CF)				Forderungswert	Risikogewichteter Forderungswert	Eigenmittelerfordernis	
					Sicherheiten ohne Sicherheitenleistungen (Sa)		Sicherheiten mit Sicherheitenleistungen		Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken			Volatilitätsanpassung des Forderungswertes (Hq)	Angepasster Wert der finanziellen Sicherheit (Cum) (-)			Volatilitäts- und Laufzeitanpassungen (-)	0%	20%	50%				100%
	Garanten	Kreditderivate			Finanzielle Sicherheiten	Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitenleistungen	Ablässe (-)	Zufüsse (+)															
		1	2	3	4=1-3	5	6	7	8	9	10	11=4-9+10	12	13	14	15=11+12-13	16	17	18	19	20=15-16-0,8*17-0,9*18	21	22
Summe Forderungen	7701000	7702000	7703000	7704000	7705000	7706000	7707000	7708000	7709000	7710000	7712001	7713000	7714000	7715000	7716000	7717000	7718000	7719000	7720000	7721000	7722000	7711000	
Aufgliederung der Summenposition nach Forderungskategorien																							
Bilanzielle Forderungen	7701005																			7721005	7722005		
Außenbilanzielle Forderungen	7701010																			7721010	7722010		
Lombantgeschäfte und Geschäfte mit längerer Abwicklungsfrist	7701015																			7721015	7722015		
Derivate	7701020																			7721020	7722020		
Produktübergreifende Netting-Vereinbarung	7701025																			7721025	7722025		
Aufgliederung der Summenposition nach Risikogewichten																							
0%	7701030																			7721030			
10%	7701035																			7721035			
20%	7701040																			7721040			
35%	7701045																			7721045			
50%	7701050																			7721050			
ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur																							
hypothekensich besichert (Gewerbliche Immobilien)	7701060																			7721060			
75%	7701065																			7721065			
100%	7701070																			7721070			
ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur																							
hypothekensich besichert (Gewerbliche Immobilien)	7701080																			7721080			
150%	7701085																			7721085			
200%	7701089																			7721089			
Andere Risikogewichte nach rationalem Ermessen	7701095																			7721095			

¹ Wenden Kreditinstitute und Kreditinstitutgruppen den Kreditrisiko-Standardansatz an und liegt ihre Bilanzsumme im geprüften Jahresabschluss des auf die Meldung vorangegangenen Geschäftsjahres unter dem Betrag von 250 Millionen Euro, haben diese Kreditinstitute obige Meldeinhalte zu übermitteln.

¹ Wenden Kreditinstitute und Kreditinstitutsgruppen den Kreditrisiko-Standardansatz an und liegt ihre Bilanzsumme im geprüften Jahresabschluss des auf die Meldung vorangegangenen Geschäftsjahres unter dem Betrag von 250 Millionen Euro, haben diese Kreditinstitute obige Meldeinhalte zu übermitteln.

KREDITRISIKO VERBÜRFUNGEN - STANDARDANSATZ																																	
TEIL A				TEIL B				TEIL C				KREDITRISIKO VERBÜRFUNGEN - STANDARDANSATZ																					
VERBÜRFUNGSTYP:				SUMME TRADITIONELLE SYNTHESE				KAP																									
Summe der verbühten Forderungen (gesamtverfügt)	Synthetische Verbühtungen: Beschreibung der verbühten Forderung				Verbühtungspositionen		Kreditkriterien: Techniken mit Substitutionsverfahren				Aufgliederung des verbühten angegebenen Forderungswertes (F*) bei unterschiedlichen Geschäfts- und Unternehmungsklassen				Aufbaustruktur der Verbühtungspositionen gemäß Risikogewichten				Risikogewichte: Forderungswert	Eigentümer: erhaltene von "CAP"	Zusätzliche Kapitalformeln: entsprechend der Aufgliederung der SA: Vorleistung zu anderen Forderungenklassen	Eigentümer: erhaltene nach "CAP"											
	Sicherheiten mit Sicherheitenklassen (CAP1) (%)	Summe Adressen (%)		Normalhaltung der Auszubildenden: zurückgekauften Kreditversicherung	Unregelmäßige Forderungen: vor Einweisung der Unternehmungsklassen	Verbühtungen nach Rating von Sicherheitenklassen und Rückstellungen	Forderungen nach Rating von Sicherheitenklassen und Rückstellungen	Sicherheiten ohne Sicherheitenklassen (Einzelgewichte: 100%)	Sicherheiten mit Sicherheitenklassen	Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von unterschiedlichen Kreditkriterien				Mit Rating (Büroklasse 1 bis 4)				125%					Tangenzmethode										
		Sicherheiten ohne Sicherheitenklassen (CAP2) (%)	Summe Adressen (%)							Kreditkriterien: Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsverfahren				Kreditkriterien: Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsverfahren				50% und <=100%					Heraus "Second loss position" in ABCP (Büroklasse: 1 bis 4)										
			1							2	3	4	5	6	7	8	9	10					11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21
Summe Forderungen	7100100	7100200	7100300	7100400	7100500	7100600	7100700	7100800	7100900	7101000	7101100	7101200	7101300	7101400	7101500	7101600	7101700	7101800	7101900	7102000	7102100	7102200	7102300	7102400	7102500	7102600	7102700	7102800	7102900	7103000	7103100	7103200	7103300
Original: Summe Forderungen	7100100	7100200	7100300	7100400	7100500	7100600	7100700	7100800	7100900	7101000	7101100	7101200	7101300	7101400	7101500	7101600	7101700	7101800	7101900	7102000	7102100	7102200	7102300	7102400	7102500	7102600	7102700	7102800	7102900	7103000	7103100	7103200	7103300
Ständige Forderungen	7100110	7100210	7100310	7100410	7100510	7100610	7100710							7101410				7101910	7102010	7102110	7102210	7102310	7102410	7102510	7102610	7102710	7102810	7102910	7103010	7103110	7103210	7103310	
Most Senior	7100115	7100215	7100315	7100415	7100515	7100615	7100715							7101415				7101915	7102015	7102115	7102215	7102315	7102415	7102515	7102615	7102715	7102815	7102915	7103015	7103115	7103215	7103315	
Mesozine	7100120	7100220	7100320	7100420	7100520	7100620	7100720							7101420				7101920	7102020	7102120	7102220	7102320	7102420	7102520	7102620	7102720	7102820	7102920	7103020	7103120	7103220	7103320	
Free Loss	7100125	7100225	7100325	7100425	7100525	7100625	7100725							7101425				7101925	7102025	7102125	7102225	7102325	7102425	7102525	7102625	7102725	7102825	7102925	7103025	7103125	7103225	7103325	
Außerordentliche Forderungen und Details	7100130	7100230	7100330	7100430	7100530	7100630	7100730							7101430				7101930	7102030	7102130	7102230	7102330	7102430	7102530	7102630	7102730	7102830	7102930	7103030	7103130	7103230	7103330	
Risiko über sonstige Rückstellung	7100135	7100235	7100335	7100435	7100535	7100635	7100735							7101435				7101935	7102035	7102135	7102235	7102335	7102435	7102535	7102635	7102735	7102835	7102935	7103035	7103135	7103235	7103335	
Investor: Summe Forderungen					7100535	7100635	7100735	7100835	7100935	7101035	7101135	7101235	7101335	7101435	7101535	7101635	7101735	7101835	7101935	7102035	7102135	7102235	7102335	7102435	7102535	7102635	7102735	7102835	7102935	7103035	7103135	7103235	7103335
Ständige Forderungen					7100540	7100640	7100740							7101440				7101940	7102040	7102140	7102240	7102340	7102440	7102540	7102640	7102740	7102840	7102940	7103040	7103140	7103240	7103340	
Most Senior					7100545	7100645	7100745							7101445				7101945	7102045	7102145	7102245	7102345	7102445	7102545	7102645	7102745	7102845	7102945	7103045	7103145	7103245	7103345	
Mesozine					7100550	7100650	7100750							7101450				7101950	7102050	7102150	7102250	7102350	7102450	7102550	7102650	7102750	7102850	7102950	7103050	7103150	7103250	7103350	
Free Loss					7100555	7100655	7100755							7101455				7101955	7102055	7102155	7102255	7102355	7102455	7102555	7102655	7102755	7102855	7102955	7103055	7103155	7103255	7103355	
Außerordentliche Forderungen und Details					7100560	7100660	7100760							7101460	7101560	7101660	7101760	7101860	7101960	7102060	7102160	7102260	7102360	7102460	7102560	7102660	7102760	7102860	7102960	7103060	7103160	7103260	7103360
Spezial: Summe Forderungen					7100565	7100665	7100765	7100865	7100965	7101065	7101165	7101265	7101365	7101465	7101565	7101665	7101765	7101865	7101965	7102065	7102165	7102265	7102365	7102465	7102565	7102665	7102765	7102865	7102965	7103065	7103165	7103265	7103365
Ständige Forderungen					7100570	7100670	7100770							7101470				7101970	7102070	7102170	7102270	7102370	7102470	7102570	7102670	7102770	7102870	7102970	7103070	7103170	7103270	7103370	
Außerordentliche Forderungen und Details					7100575	7100675	7100775							7101475	7101575	7101675	7101775	7101875	7101975	7102075	7102175	7102275	7102375	7102475	7102575	7102675	7102775	7102875	7102975	7103075	7103175	7103275	7103375

Kapitel "Kreditrisiko - Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRB)"

Periodizität: Vierteljährlich

☐ Anordnung der niedrigsten zu höchsten durchschnittlichen Aufwandskriterien gemäß Rangfolge. Die Aufwandskriterien in Folge Ausfalls beträgt 100%. Fortsetzungskriterien nach der Alternativen-Anwendung von hypobathischer Bezeichnung ist zu erfordern, wenn es keine eigenen LG-Schlüsseln gibt.
 Hypobathischer Bezeichnung ist zu erfordern, wenn es keine eigenen LG-Schlüsseln gibt.
 Die Daten beziehen sich auf Fortsetzungskriterien "Prozesskriterien", "Umsatzkriterien" und die "Summe Fortsetzungskriterien" auf Verfüglich.

KREDITRISIKO BETEILIGUNGEN - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ										KREDITRISIKO BETEILIGUNGEN - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ										
TEIL A										TEIL B										
	"Ratingstufe" ← →	Internes Ratingssystem			Bruttoforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsfaktoren	Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten				Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditrisikomindernde Techniken		Forderungswert		Forderungsgewichtete durchschnittliche Verlustquote bei Ausfall (LGD) in %	Risikogewichteter Forderungswert	Eigenmittel-erfordernis	Zusatzinformationen:			
		(PD)-Bandbreite		Ausfallswahrscheinlichkeit aufgrund Bonitätsseinstufung (%)		Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen		Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken									Erwarteter Verlust	Wertberichtigungen und Rückstellungen		
		Untere PD-Grenze in %	Obere PD-Grenze in %			Garantien	Kreditderivate	Abflüsse (→)	Zuflüsse (←)	Hievon außerbilanzielle Forderungen	Hievon außerbilanzielle Forderungen									
		1	2			3	4	5	6	7	8	9	10						11	12
Summe IRB-Forderungsklasse Beteiligungen														8514000	7712050	8516000	8517000			
1. PD/LGD-Ansatz: Summe					8504005	8505005	8506005	8507005	8508005	8509005	8510005	8511005	8512005	8513005	8514005	8515005				
Aufgliederung der Summenposition gemäß PD/LGD-Ansatz nach Ratingstufe																				
Ratingstufe (a): 1 2 N	← →	8501010	8502010	8503010	8504010					8509010	8510010	8511010	8512010	8513010	8514010	8515010				
2. Einfacher risikogewichteter Ansatz: Summe					8504015	8505015	8506015	8507015	8508015	8509015	8510015	8511015	8512015		8514015	8515015				
Aufgliederung der Summenposition gemäß dem einfachen risikogewichteten Ansatz nach Risikogewichten																				
Risikogewicht: 190% 290% 370%					8504020					8509020	8510020	8511020	8512020			8514020	8515020			
					8504025					8509025	8510025	8511025	8512025			8514025	8515025			
					8504030					8509030	8510030	8511030	8512030			8514030	8515030			
3. Ansatz nach internem Modell																	8514035	8515035	8517035	
4. Grandfathering					8504040													8514040	8515040	8517040

(a) Anordnung von der niedrigsten zur höchsten durchschnittlichen Ausfallswahrscheinlichkeit gemäß Ratingstufe.

KREDITRISIKO VERBIEFGEN DETAILS: DETAILIERTE INFORMATIONEN ZU VERBIEFGEN DURCH ORIGINATOREN UND SPONSOREN														KREDITRISIKO VERBIEFGEN DETAILS: DETAILIERTE INFORMATIONEN ZU VERBIEFGEN DURCH ORIGINATOREN UND SPONSOREN															
TEIL A														TEIL B															
Laufende Nummer	Kennung der Verbriefung	Verbriefungstyp: (Traditionell/ Synthetisch)	Rolle des Instituts: Sponsor/Originator	Nicht-ABCP (asset backed commercial paper) Programme		Verbrieft Forderungen (Originatorseitig)								Verbriefungsstruktur	Verbriebspositionen (Ursprüngliche Forderung vor Anwendung der Umrechnungsaktionen)										Abzug von den Eigenmitteln (-)	Eigenmittel: erhöhtes „CAP“	Eigenmittel: erhöhtes nach		
				Verbriefungsdatum (mm/jj)	Summe der verbrieften Forderungen (originatorseitig zum Zeitpunkt des Verbriefungsdatums)	Summe	Institutsanteil (%)	Typ	Angewandeter Ansatz (SARF/SARF)	Anzahl der Forderungen	ELGD (%)	Wertberichtigungen und Rückstellungen	Eigenmittelerhöhter vor Verbriefung in % der Forderungsbeträge		Bilanzielle Forderungen				Außerbilanzielle Forderungen und Derivate			Vorzeitige Rückzahlung (early amortisation)							
															Most Senior		Mezzanine		First Loss		Direktes Kreditsubstitut		Anerkannte Liquiditätsfaktoren	Andere				Kontrolliert? (Ja/Nein)	Angewandter Umrechnungsfaktor
															Mit Rating	Ohne Rating	Mit Rating	Ohne Rating	Mit Rating	Ohne Rating									
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29	
< - >	7300002	7300003	7300004	7300005	7300006	7300007	7300008	7300009	7300010	7300011	7300012	7300013	7300014	7300015	7300016	7300017	7300018	7300019	7300020	7300021	7300022	7300023	7300024	7300025	7300026	7300027	7300028	7300029	

Kapitel "Operationelles Risiko"

Periodizität: Vierteljährlich

OPERATIONELLES RISIKO

Bankgeschäfte	Betriebserträge			Summe aushaftender Kredite und Darlehen (bei Anwendung des Alternativen Standardansatzes)			Eigenmittelerfordernis	Zusatzangaben zum Fortgeschrittenen Messansatz (AMA), sofern anwendbar											
	Jahr-3	Jahr-2	Vorjahr	Durchschnitt Jahr-3	Durchschnitt Jahr-2	Durchschnitt Vorjahr		Hievon: durch Allokationsmechanismus zugeteilt	Eigenmittelerfordernis vor Anrechnung von erwarteten Verlusten oder Risiko verlagernder Techniken	Aus Eigenmittelerfordernis herausgerechneter erwarteter Verlust	Eigenmittel-erleichterung durch Risiko verlagernde Techniken	Hievon: durch Versicherungen	Überschussbetrag anrechenbarer risiko-verlagernder Techniken						
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	9a	10	10a	12						
Basisindikatoransatz	9001000	9002000	9003000				7741000												
Standardansatz (SA)/ Standardansatz (ASA) Alternativer							7742000												
Standardansatz																			
Unternehmensfinanzierung	9001005	9002005	9003005																
Handel	9001010	9002010	9003010																
Wertpapiergeschäft	9001015	9002015	9003015																
Firmenkundengeschäft	9001020	9002020	9003020																
Privatkundengeschäft	9001025	9002025	9003025																
Zahlungsverkehr und Abwicklung	9001030	9002030	9003030																
Depot- und Treuhandgeschäft	9001035	9002035	9003035																
Vermögensverwaltung	9001040	9002040	9003040																
Alternativer Standardansatz (ASA)																			
Firmenkundengeschäft	9001045	9002045	9003045	9004045	9005045	9006045													
Privatkundengeschäft	9001050	9002050	9003050	9004050	9005050	9006050													
Fortgeschrittener Messansatz (AMA)	9001055	9002055	9003055				7743000	9008055	9009055	9010055	9011055	9012055	9013055						

Kapitel "Positionen des Handelsbuchs"

Periodizität: Vierteljährlich

MARKTRISIKO ZINSBEZOGENER INSTRUMENTE IM HANDELSBUCH (§ 205f SOLVAV)

	ungewichtet	Risikogewicht in %	Eigenmittelerfordernis
	1	2	3
Zinsbezogene Instrumente des Handelsbuchs			7731015 (Summe 1+2+3+4+5)
1. Allgemeines Positionsrisiko. Laufzeitbandmethode			5003005
2. Allgemeines Positionsrisiko. Durationsmethode			5003010
3. Spezifisches Positionsrisiko gemäß § 206 SOLVAV	5001015		5003015 (Summe 3.1+3.2+3.3+3.4+3.5)
3.1 zinsbezogene Instrumente der ersten Kategorie	5001020	0,00	5003020
3.2 zinsbezogene Instrumente der zweiten Kategorie	5001025 (Summe)		5003025 (Summe)
3.2.a bis 6 Monate	5001030	0,25	5003030
3.2.b über 6 Monate	5001035	1,00	5003035
3.2.c über 24 Monate	5001040	1,60	5003040
3.3 zinsbezogene Instrumente der dritten Kategorie	5001045	8,00	5003045
3.4 zinsbezogene Instrumente der vierten Kategorie	5001050	12,00	5003050
3.5 verbriefte Forderungen, die mit max. 1250% und darunter zu gewichten sind sowie Positionen ohne Rating einer anerkannten Ratingagentur	5001051		5003051
4. Positionsrisiko Investmentfonds gemäß § 209 Abs. 2 SOLVAV			5003055
5. Nicht-lineare Optionsrisiken			5003060

MARKTRISIKO POSITIONSRISIKO IN SUBSTANZWERTEN GEMÄß § 207 SOLVAV

	ungewichtet	Risikogewicht in %	EM-Erfordernis
	1	2	3
Substanzwerte im Handelsbuch			7731020 (1+2+3+4+5)
1. Allgemeines Risiko	5101005	8,00	5103005
2. Spezifisches Risiko	5101010		5103010
2.1 Substanzwerte gemäß § 207 Abs. 2 1.Satz SOLVAV	5101015	4,00	5103015
2.2 Substanzwerte gemäß § 207 Abs. 2 Z 1 bis 4 SOLVAV	5101020	2,00	5103020
3. Aktienindexterminkontrakte bei Anwendung von § 208 Abs. 2 SOLVAV	5101025	0,50	5103025
4. Nicht-lineare Optionsrisiken			5103030
5 Positionsrisiko Investmentfonds gemäß § 209 Abs. 2 SOLVAV			5103035

MARKTRISIKO ABWICKLUNGSRISIKO

Abwicklungsrisiko	ungewichtet	Risikogewicht in %	Eigenmittel- erfordernis
	1	2	3
1. Anzahl der Arbeitstage nach dem festgesetzten Abrechnungstermin			7720000
1.1. bis 4 Tage		0,0	
1.2. 5 bis 15 Tage	5301015	8,0	5303015
1.3. 16 bis 30 Tage	5301020	50,0	5303020
1.4. 31 bis 45 Tage	5301025	75,0	5303025
1.5. 46 und mehr Tage	5301030	100,0	5303030

Kapitel "Fortsetzung Ordnungsnormen"

Periodizität: Monatlich

HANDELSBUCH - §§ 22n bis 22q BWG

1. Volumen des Handelsbuches gemäß § 22q Abs. 1 Z 1 bis 4 BWG	
	Anzahl der Tage
bis einschließlich 5 vH des Geschäftsvolumens	7751011
über 5 vH bis einschließlich 6 vH des Geschäftsvolumens	7751012
über 6 vH des Geschäftsvolumens	7751013
	Anzahl der Tage
bis einschließlich 15 Mio. EUR	7751021
über 15 Mio. EUR bis einschließlich 20 Mio. EUR	7751022
über 20 Mio. EUR	7751023
	Betrag
Geschäftsvolumen	7751001
Handelsbuch	7751002

OFFENE DEISENPOSITIONEN GEMÄß § 22 Abs. 1 Z 3 und § 22o Abs. 2 Z 12 BWG

	ISO-Code ¹	Betrag
1. Monatsendstand der offenen Deisenpositionen pro Währung	<__>	6800000
2. Höchststand der offenen Deisenpositionen pro Währung im Monat	<__>	6800001

1) Länderkennzeichen gemäß Definition der Internationalen Organisation für Standardisierung (ISO). Alle Währungen, bei denen die offene Fremdwährungsposition 1 vH der Bilanzsumme überschreitet, sind meldepflichtig.

INTERNE MODELLE

	Durchschnitt der letzten 60 Tage x Multiplikator	Value at Risk des Vortages	Zuschlag für das spezifische Positions- risiko	Zuschlag für das zusätzliche Ausfalls- risiko	Eigenmittel- erfordernis	Zusatzinformation:	
						Anzahl der Überschreitungen (Ausnahmen) während der letzten 250 Tage	Multiplika- tor
						1	2
Gesamtpositionen	5201000	5202000	5203000	5204000	7732000	5206000	5207000
Marktrisikokomponenten							
1. zinsbezogene Instrumente	5201005 (Summe)	5202005 (Summe)	5203005	5204005			
1.1 zinsbez. Instrumente - Allgemeines Positionsrisiko	5201010	5202010					
1.2 zinsbez. Instrumente - Spezifisches Positionsrisiko	5201015	5202015					
2. Substanzwerte	5201020 (Summe)	5202020 (Summe)	5203020	5204020			
2.1 Substanzwerte - Allgemeines Positionsrisiko	5201025	5202025					
2.2 Substanzwerte - Spezifisches Positionsrisiko	5201030	5202030					
3. Fremdwährungsrisiko	5201035	5202035					
4. Warenpositionsrisiko	5201040	5202040					
5. Allgemeines Positionsrisiko - Gesamt	5201045	5202045					
6. Spezifisches Positionsrisiko - Gesamt	5201050	5202050	5203050	5204050			

**§ 25 BWG - LIQUIDITÄT
auf Basis von Restlaufzeiten**

1. Liquidität 1	
a) Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 7 Z 1 BWG (nur von Zentralinstituten auszufüllen)	Durchschnitt¹
Einlagen bei Zentralinstituten unter 30 Tagen (gemäß § 25 Abs. 4 Z 1 BWG)	6311100
b) Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 7 Z 2 BWG	Durchschnitt²
Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 4 Z 1 bis 5 BWG	6400100
- Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 5 Z 1 bis 6 BWG	6401100
Summe der Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 4 und 5 BWG	6402100
c) Flüssige Mittel 1. Grades gemäß § 25 Abs. 6 BWG	Durchschnitt³
Summe	6500100
2. Liquidität 2	
a) Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 8 BWG	15. des Berichtsmonats
Euro-Verpflichtungen Liquidität 1 gemäß § 25 Abs. 8 Z 1 BWG	6403115
+ Euro-Verpflichtungen Liquidität 2 gemäß § 25 Abs. 8 Z 2 bis 5 BWG	6600115
- Euro-Verpflichtungen Liquidität 2 gemäß § 25 Abs. 9 BWG	6601115
Summe	6602115
b) Flüssige Mittel 2. Grades gemäß § 25 Abs. 10 und 11 BWG	Ultimo des Berichtsmonats
Flüssige Mittel 2. Grades gemäß § 25 Abs. 10 Z 1 bis 9 BWG	6700131
. Überschuss Liquidität 1 gemäß § 25 Abs. 10 Z 7 BWG	6723131
- Flüssige Mittel 2. Grades gemäß § 25 Abs. 11 BWG	6701131
Summe	6702131

¹ Arithmetisches Mittel der Tagesendstände am Letzten des vorletzten Monats sowie am 7., 15. und 23. des Vormonats.

² Arithmetisches Mittel der Tagesstände am Letzten des Vormonats sowie am 7., 15. und 23. des laufenden Monats.

³ Kalenderdurchschnitt

§ 27 BWG - GROSSVERANLAGUNGEN**1. A) Großveranlagung gemäß § 27 Abs. 2 Z 1 und 2 BWG****B) Großveranlagung gemäß § 27 Abs. 2 BWG nach Gewichtung****C) Inanspruchnahme der Übergangsbestimmung der vertraglichen Bindung gemäß § 103 Z 21 lit. d BWG**

Meldeblock A											Meldeblock B			Meldeblock C
Ident-nummer	GVA-Kenn-zeichen ¹	Veranlagung vor Risiko-vorsorge	GVA nach Abzug von Risiko-vorsorge	hievon Kategorien gemäß § 27 Abs. 2 BWG		Zurechnung gemäß § 27 Abs. 5 BWG zu einem Dritten		Kreditrisiko-mindernde Sicherheiten ² - Zurechnung zu Vertragspartner		GVA nach Zurechnungen	Gewicht	Un-gewichteter Wert	Gewichteter Wert	Vertraglich gebundener Wert nach Gewichtung
						Ident-nummer	Betrag	Ident-nummer	Betrag					
<...>	7410001	7410002	7410004	Aktivposten	7410005	<...>	7410009	<...>	7410010	7410011	mit 0%-Gewichtung	7410012		
											mit 20%-Gewichtung	7410015	7410016	7410017
											mit 50%-Gewichtung	7410018	7410019	7410020
											mit 100%-Gewichtung	7410021	7410022	7410023
											mit anderen Gewichten	7410024	7410025	7410026
											Summe	7410027	7410028	7410029
				Derivate	7410007									
				Positionen des Handelsbuchs	7410008									

2. Zusatzangaben für unter Punkt 1 gemeldete Gruppen verbundener Kunden

Identnummer	Einzelidentnummern der Gruppe	GVA nach Abzug von Risikovorsorge
<...>	<...>	7410003

3. Gesamtheit aller Großveranlagungen

Wert
7410030

4. Summe der nicht in der Gesamtheit enthaltenen Großveranlagungen

Wert
7410031

1) Kennzeichen: GVA-Gewährung an eigene Gruppe verbundener Kunden: "1", übrige Gewährungen: "2"

2) Ausschließlich bei Anwendung der umfassenden Methode zur Berücksichtigung finanzieller Sicherheiten gemäß § 27 Abs. 3b BWG (durchgängig für alle Großveranlagungen) oder des fortgeschrittenen IRB-Ansatzes

5. Großveranlagungen gemäß § 27 Abs. 2 BWG zum Ende des Geschäftsjahres

Identnummer	Höhe der voraussichtlichen Risikovorsorge
<...>	7410032

§ 29 BWG - BETEILIGUNGEN

Alle qualifizierten Beteiligungen über 15 vH der anrechenbaren Eigenmittel

Identnummer	Beteiligung Betrag
<...>	7900001

	Betrag
Gesamtbuchwert der qualifizierten Beteiligungen (an anderen Unternehmen als den in § 29 Abs. 1 Z 1 bis 3 BWG genannten)	7900000
Summe der Überschreitung der Beteiligungsgrenzen gemäß § 29 Abs. 1 BWG	7900011
Summe der Überschreitung der Beteiligungsgrenzen gemäß § 29 Abs. 2 BWG	7900012