

# **Anlage A1**

## **Ordnungsnormenausweis für Kreditinstitute gemäß § 1 ONA-V**

|  |
|--|
| <b>Kapitel "Kapitaladäquanzblatt (CA-TEMPLATE)" gemäß § 22 BWG Eigenmittelerfordernis und § 23 BWG Eigenmittel</b> |
|--|

Periodizität: Monatlich

**CA-TEMPLATE unkonsolidiert**

|                   |   | <b>Betrag</b> |
|-------------------|---|---------------|
| <b>1</b>          | <b>Eigenmittel insgesamt</b>  | 7800000       |
| <b>1.1</b>        | <b>Kernkapital</b>  | 7810000       |
| <b>1.1.1</b>      | <b>Zwischensumme Kapitalia</b>  | 7811000       |
| <b>1.1.1*</b>     | hievon begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kernkapitalinstrumente   | 7811002       |
| <b>1.1.1**</b>    | hievon begrenzt anrechenbare, innovative Kernkapitalinstrumente   | 7811004       |
| <b>1.1.1.1</b>    | <i>Eingezahltes Kapital (Geschäfts-, Grund-, Stamm-, Dotationskapital und Geschäftsguthaben) ohne Vorzugsaktien mit Dividendennachzahlungspflicht</i> | 7811006       |
| <b>1.1.1.2</b>    | <i>(-) Eigene Aktien oder Geschäftsanteile</i>  | 7811008       |
| <b>1.1.1.3</b>    | <i>Kapitalrücklage (Emissionsagiokonto)</i>   | 7811010       |
| <b>1.1.1.4</b>    | <i>Sonstige als eingezahltes Kapital anrechenbare Instrumente (z.B. unbefristete stille Beteiligungen)</i>  | 7811012       |
| <b>1.1.2</b>      | <b>Sonstige anrechenbare Rücklagen</b>  | 7812000       |
| <b>1.1.2*</b>     | <b>hievon Haftrücklage</b>  | 7812003       |
| <b>1.1.2.1</b>    | <i>Sonstige Rücklagen</i>   | 7812006       |
| <b>1.1.2.2</b>    | <i>Minderheitsbeteiligungen</i>   | 7812009       |
| <b>1.1.2.2*</b>   | hievon begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kapitalinstrumente   | 7812012       |
| <b>1.1.2.2**</b>  | hievon begrenzt anrechenbare, innovative Kapitalinstrumente   | 7812015       |
| <b>1.1.2.3</b>    | <i>Zwischengewinn</i>   | 7812018       |
| <b>1.1.2.4</b>    | <i>(-) Bilanzverlust sowie materielle negative Ergebnisse im laufenden Geschäftsjahr</i>  | 7812021       |
| <b>1.1.2.5</b>    | <i>(-) Nettogewinne aus der Kapitalisierung künftiger Erträge verbriefter Forderungen</i>   | 7812024       |
| <b>1.1.2.6</b>    | <i>Im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften (Prudential Filters)</i>   | 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       |
| <b>1.1.2.6.17</b> | <b>+/- Unterschiedsbetrag aus der Zusammenfassung von Eigenkapital und Beteiligungen</b>  | 7812078       |
| <b>1.1.2.6.18</b> | <b>+/- Umrechnungsdifferenzen ausländischer Währungen</b>   | 7812081       |
| <b>1.1.2.6.19</b> | <b>+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung der nachgeordneten Institute</b>   | 7812084       |
| <b>1.1.2.6.20</b> | <b>+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung von Beteiligungen an Unternehmen</b>   | 7812087       |
| <b>1.1.3</b>      | <b>Fonds für allgemeine Bankrisiken</b>   | 7813000       |
| <b>1.1.4</b>      | <b>Andere, landesspezifische Kernkapitalbestandteile</b>  | 7814000       |
| <b>1.1.4.1</b>    | <i>Begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kernkapitalinstrumente</i>   | 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      | <b>(-) Sonstige Abzugspositionen vom Kernkapital</b>   | 7815000 |
| 1.1.5.1    | <i>(-) Immaterielle Vermögensgegenstände</i>   | 7815002 |
| 1.1.5.2    | <i>(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze nicht innovativer Kernkapitalinstrumente (&gt; 50% des Kernkapitals)</i>   | 7815004 |
| 1.1.5.3    | <i>(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze innovativer Kernkapitalinstrumente (&gt; 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        | <b>Ergänzende Eigenmittel</b>  | 7820000 |
| 1.2.1      | <b>Zwischensumme I</b>   | 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, grundstückgleichen 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      | <b>Zwischensumme II</b>  | 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      | <b>(-) Abzugspositionen von der Summe der ergänzenden Eigenmittel</b>  | 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        | <b>(-) Abzugspositionen vom Kernkapital und von ergänzenden Eigenmittel</b>  | 7830000 |
| 1.3.T1*    | <i>hievon (-) vom Kernkapital</i>  | 7830002 |
| 1.3.T2*    | <i>hievon (-) von ergänzenden Eigenmittel</i>  | 7830004 |
| 1.3.1      | <b>(-) Anteile an anderen Kredit- und Finanzinstituten von mehr als 10% ihres Kapitals</b>   | 7830006 |
| 1.3.2      | <b>(-) 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</b> | 7830008 |
| 1.3.3      | <b>(-) Kapitalbestandteile an anderen als unter 1.3.1 und 1.3.2 genannten Kredit- und Finanzinstituten von höchstens 10% ihres Kapitals, sofern diese zusammengenommen mehr als 10% der Eigenmittel des Kreditinstitutes übersteigen</b> | 7830010 |
| 1.3.4      | <b>(-) Beteiligungen an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften</b>  | 7830012 |
| 1.3.5      | <b>(-) Sonstige Kapitalbestandteile an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften</b>   | 7830014 |
| 1.3.6      | <b>(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital und von ergänzenden Eigenmittel</b>  | 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         | <b>Anrechenbares Kernkapital und anrechenbare ergänzende Eigenmittel (nach Abzugsposten)</b>  | 7850001 |
| 1.7         | <b>Tier III-Kapital</b>   | 7840000 |
| 1.7.1       | <b>Zur Umwidmung in Tier III-Kapital zur Verfügung stehendes Tier II-Kapital</b>  | 7840005 |
| 1.7.2       | <b>Nettogewinn aus dem Handelsbuch</b>  | 7840010 |
| 1.7.3       | <b>Kurzfristiges nachrangiges Kapital</b>   | 7840015 |
| 1.7.4       | (-) Illiquide Aktiva  | 7840020 |
| 1.7.5       | <b>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 7 BWG</b>   | 7840025 |
| 1.7.6       | (-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Tier III-Kapital   | 7840030 |
| 1.7.7       | (-) Ungenutztes, aber anrechenbares Tier III-Kapital  | 7840035 |
| 1.8         | <b>ZUSATZINFORMATIONEN:</b>   |         |
| 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       | <b>Vorhandene Nachrangkapitalia gemäß § 23 Abs. 14 Z 5 BWG</b>  | 7850045 |
| 1.9         | <b>Wert des Fondsvermögens gemäß § 3 Abs. 4 BWG</b>   | 7850050 |
| 1.10        | <b>Eigenmittel-Basis für Großveranlagungen gemäß § 27 BWG</b>   | 7850055 |
| 2           | <b>Gesamteigenmittelerfordernis</b>   | 7700000 |
| 2.1         | <b>EIGENMITTELERFORDERNIS für das Kreditrisiko gemäß §§ 22a bis 22h BWG</b>   | 7710000 |
| 2.1*        | <i>hievon Kontrahentenausfallsrisiko aus dem Handelsbuch</i>  | 7710001 |
| 2.1.1       | <b>Standardansatz (SA)</b>  | 7711000 |
| 2.1.1.1a    | <b>Standardansatz-Forderungsklassen (ohne Berücksichtigung von Verbriefungspositionen)</b>  | 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     | <b>Verbriefungspositionen - Standardansatz</b>  | 7711060 |
| 2.1.2       | <b>Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRB)</b>  | 7712000 |
| 2.1.2.1     | <b>Auf interne Ratings basierender Ansatz - ohne eigene LGD-Schätzung/Anwendung von Umrechnungsfaktoren</b>   | 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     | <b>IRB-Ansatz - mit eigener LGD-Schätzung/Anwendung von Umrechnungsfaktoren</b>   | 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     | <b>Beteiligungspositionen IRB</b>   | 7712050 |
| 2.1.2.4     | <b>Verbriefungspositionen IRB</b>   | 7712055 |

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

TEIL A

TEIL B

SA Forderungskategorie:

|                          | Bruttoforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsfaktoren |         | Wertberichtigungen und Rückstellungen | Nettobeforderung | Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten |                |   |  |  |              | Nettobeforderung 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 |  |   | Angesetzter Wert der Forderung (E <sup>1</sup> ) | Aufgliederung des vollständig angepassten Forderungswertes bei außerbilanziellen Geschäften durch Umrechnungsfaktoren (Credit Conversion Factors; CF) |         |         |         | Forderungswert | Risikogewichteter Forderungswert | Eigenmittelerfordernis |      |                        |    |    |
|--------------------------|--|---------|---------------------------------------|------------------|---|----------------|---|--|--|--------------|---|---|--|---|--|---|---------|---------|---------|----------------|----------------------------------|------------------------|------|------------------------|----|----|
|                          | 1  | 2       |                                       |                  | Sicherheiten ohne Sicherheitenleistungen (Ga)             |                | Sicherheiten mit Sicherheitenleistungen |  | Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken |              |   | Volatilitätsanpassung des Forderungswertes (H <sub>e</sub> )  | Angesetzter Wert der Finanztellen Sicherheit (C <sub>oam</sub> ) (I) | Volatilitäts- und Laufzeitanpassungen (L) |  | 15=11+12-13   | 0%      | 20%     | 50%     |                |                                  |                        | 100% | 20=15-16-0,8*17-0,5*18 | 21 | 22 |
|                          |  |         |                                       |                  | Garantien   | Kreditderivate | Finanzielle Sicherheiten                | Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitenleistungen | Ablüsse (-)  | Zuflüsse (+) |   |   |  |   |  |   |         |         |         |                |                                  |                        |      |                        |    |    |
|                          |  |         |                                       |                  | 5   | 6              | 7                                       | 8  | 9  | 10           |   |   |  |   |  |   |         |         |         |                |                                  |                        |      |                        |    |    |
| <b>Summe Forderungen</b> | 7701000  | 7702000 | 7703000                               | 7704000          | 7705000   | 7706000        | 7707000                                 | 7708000  | 7709000  | 7710000      | 7712001   | 7713000   | 7714000  | 7715000                                   | 7716000  | 7717000   | 7718000 | 7719000 | 7724000 | 7721000        | 7722000                          | 7711000                |      |                        |    |    |

**Aufgliederung der Summenposition nach Forderungskategorien**

|  |         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |         |         |         |  |
|--|---------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|---------|---------|---------|--|
| Bilanzielle Forderungen                                      | 7701005 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | 7721005 | 7722005 |         |  |
| Außerbilanzielle Forderungen                                 | 7701010 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |         | 7721010 | 7722010 |  |
| Lombardgeschäfte und Geschäfte mit längerer Abwicklungsfrist | 7701015 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |         | 7721015 | 7722015 |  |
| Derivate   | 7701020 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |         | 7721020 | 7722020 |  |
| Produktbezogene Nettingvereinbarung                          | 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 |         |  |         |         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |         |  |  |  |  |  |  |         |         |         |
| hypothekarsich 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 |         |  |         |         |  |  |  |  |  |  |  |  |  |         |  |  |  |  |  |  |         |         |         |
| hypothekarsich 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 rationalem Ermessen           | 7701095 |  | 7703095 | 7704095 |  |  |  |  |  |  |  |  |  | 7716095 |  |  |  |  |  |  | 7721095 | 7722095 | 7711095 |

**KREDITRISIKO-STANDARDANSATZ (für Melde-KI, die unter dem Schwellenwert liegen)**

**TEIL A**

SA Forderungsklasse: < ... >

**TEIL B**

|                          | Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten    |         |                                       |                |  |         |  |  |  |  | Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditrisikomindernde Techniken | Kreditrisikomindernde Techniken in Form von Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen, ausgenommen andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen; Finanzielle Sicherheiten bei Anwendung der umfassenden Methode |         |         | Aufgliederung des angepassten Forderungswertes bei außerbilanziellen Geschäften durch Umrechnungsfaktoren (Credit Conversion Factor; CF) |         |         |         | Forderungswert | Risikogewichteter Forderungswert | Eigenmittelforderung |         |
|--------------------------|--|---------|---------------------------------------|----------------|--|---------|--|--|--|--|---|---|---------|---------|--|---------|---------|---------|----------------|----------------------------------|----------------------|---------|
|                          | Bruttoforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsfaktoren |         | Wertberichtigungen und Rückstellungen | Nettoforderung | Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen (Ga) |         | Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen |  | Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken |  |   | Angepasster Wert der Forderung (E*)   |         |         |  |         |         |         |                |                                  |                      |         |
|                          | Heaven Kontaherent-auditorisiko                              | 1       |                                       |                | 2  | 3       | 4-1-3                                  | Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen (Ga) |  | Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen |   |   | 0%      | 20%     | 50%  | 100%    |         |         |                |                                  |                      |         |
|                          |  |         | Garantien                             | Krediterivate  |  |         |  | Finanzielle Sicherheiten                     | Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen  | Ablässe (-)                            |   | Zuflüsse (+)  |         |         |  |         |         |         |                |                                  |                      |         |
|                          | 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*17-0,5*18           | 21                   | 22      |
| <b>Summe Forderungen</b> | 7701000  | 7702000 | 7703000                               | 7704000        | 7705000                                      | 7706000 | 7707000                                | 7708000                                      | 7709000  | 7710000                                | 7712001   | 7713000   | 7714000 | 7715000 | 7716000  | 7717000 | 7718000 | 7719000 | 7720000        | 7721000                          | 7722000              | 7710000 |

**Aufgliederung der Summenposition nach Forderungskategorien**

|  |         |         |         |
|--|---------|---------|---------|
| Bilanzielle Forderungen                                      | 7701005 | 7721005 | 7722005 |
| Außerbilanzielle Forderungen                                 | 7701010 | 7721010 | 7722010 |
| Lombardgeschäfte und Geschäfte mit längerer Abarückungsfrist | 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 |         |         |
| hypothekensichergestellt (Gemeinhliche Immobilien)       | 7701060 | 7721060 |
| 75%  | 7701065 | 7721065 |
| 100%   | 7701070 | 7721070 |
| ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur |         |         |
| hypothekensichergestellt (Gemeinhliche Immobilien)       | 7701080 | 7721080 |
| 150%   | 7701085 | 7721085 |
| 200%   | 7701089 | 7721089 |
| Andere Risikogewichte nach nationalem Ermessen           | 7701095 | 7721095 |

<sup>1</sup> Wenden Kreditinstitute und Kreditrisikostützgruppen den Kreditrisiko-Standardansatz an und legen ihre Bilanzsumme im geprüften Jahresabschluss des auf die Meldung vorangegangenen Geschäftsjahres unter dem Betrag von 250 Millionen Euro, haben diese Kreditinstitute obige Meldedaten zu übermitteln.

<sup>1</sup> Wenden Kreditinstitute und Kreditrisikostützgruppen den Kreditrisiko-Standardansatz an und legen ihre Bilanzsumme im geprüften Jahresabschluss des auf die Meldung vorangegangenen Geschäftsjahres unter dem Betrag von 250 Millionen Euro, haben diese Kreditinstitute obige Meldedaten zu übermitteln.



| KREDITRISIKO VERBIEFUNGEN - STANDARDANSATZ       |  |                 |  |  |                   |   |   |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
|--|--|-----------------|--|--|-------------------|---|---|---|---|-----------------|-------------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| TEIL A   |  |                 |  |  |                   |   |   |   |   | TEIL B          |                   |   |   |   |   |   |   |   |   | TEIL C  |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| VERBIEFUNGSTYP                                   |  |                 |  |  |                   |   |   |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| SUMMIERADDITIONELL/SYNETHETISCH                  |  |                 |  |  |                   |   |   |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Summe der verbilligten Forderungen (engpassfrei) | Synthetische Verbindungen: Beschreibung der verbilligten Forderung |                 |  |  | Verkaufsgarantien | Forderungen nach Rating von Sicherheiten und Rückstellungen | Forderungen nach Rating von Sicherheiten und Rückstellungen | Kreditkumulative Techniken mit Substitutionsfaktoren              |   |                 |                   | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren | Kreditkumulative Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfaktoren |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
|  | Sicherheiten mit Sicherheitenleistungen (CMT) (%)                  | Summe Abbau (%) | Normalfall der Liquiditätsrisiko: Rückstellungen | Ungewöhnliche Forderungen vor Anwendung der Umrechnungspläne |                   |   |   | Sicherheiten ohne Sicherheitenleistungen (Erlösangewiesener Wert) | Sicherheiten mit Sicherheitenleistungen | Summe Abbau (%) | Summe Zufüsse (%) |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren | Reständerung nach Substitutionsfaktoren |
|  | 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                                      | 30                                      | 31                                      | 32                                      |
| Summe Forderungen                                | 710100   | 710200          | 710300   | 710400   | 710500            | 710600  | 710700  | 710800  | 710900                                  | 711000          | 711100            | 711200  | 711300  | 711400  | 711500  | 711600  | 711700  | 711800  | 711900  | 712000  | 712100  | 712200  | 712300  | 712400  | 712500  | 712600  | 712700  | 712800  | 712900  | 713000  | 713100  | 713200  | 713300  |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Original: Summe Forderungen                      | 710105   | 710205          | 710305   | 710405   | 710505            | 710605  | 710705  | 710805  | 710905                                  | 711005          | 711105            | 711205  | 711305  | 711405  | 711505  | 711605  | 711705  | 711805  | 711905  | 712005  | 712105  | 712205  | 712305  | 712405  | 712505  | 712605  | 712705  | 712805  | 712905  | 713005  | 713105  | 713205  | 713305  |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Statische Forderungen                            | 710110   | 710210          | 710310   | 710410   | 710510            | 710610  | 710710  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Most Senior                                      | 710115   | 710215          | 710315   | 710415   | 710515            | 710615  | 710715  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Mezanine   | 710120   | 710220          | 710320   | 710420   | 710520            | 710620  | 710720  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Free Loss  | 710125   | 710225          | 710325   | 710425   | 710525            | 710625  | 710725  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Außerordentliche Forderungen und Details         | 710130   | 710230          | 710330   | 710430   | 710530            | 710630  | 710730  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Restrikt über vorrangige Rückzahlung             | 710135   | 710235          | 710335   | 710435   | 710535            | 710635  | 710735  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Investor: Summe Forderungen                      |  |                 |  |  | 710535            | 710635  | 710735  | 710835  | 710935                                  | 711035          | 711135            | 711235  | 711335  | 711435  | 711535  | 711635  | 711735  | 711835  | 711935  | 712035  | 712135  | 712235  | 712335  | 712435  | 712535  | 712635  | 712735  | 712835  | 712935  | 713035  | 713135  | 713235  | 713335  |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Statische Forderungen                            |  |                 |  |  | 710540            | 710640  | 710740  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Most Senior                                      |  |                 |  |  | 710545            | 710645  | 710745  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Mezanine   |  |                 |  |  | 710550            | 710650  | 710750  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Free Loss  |  |                 |  |  | 710555            | 710655  | 710755  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Außerordentliche Forderungen und Details         |  |                 |  |  | 710560            | 710660  | 710760  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Spezial: Summe Forderungen                       |  |                 |  |  | 710565            | 710665  | 710765  | 710865  | 710965                                  | 711065          | 711165            | 711265  | 711365  | 711465  | 711565  | 711665  | 711765  | 711865  | 711965  | 712065  | 712165  | 712265  | 712365  | 712465  | 712565  | 712665  | 712765  | 712865  | 712965  | 713065  | 713165  | 713265  | 713365  |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Statische Forderungen                            |  |                 |  |  | 710570            | 710670  | 710770  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Außerordentliche Forderungen und Details         |  |                 |  |  | 710575            | 710675  | 710775  |   |   |                 |                   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |

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

Periodizität: Vierteljährlich



| KREDITRISIKO BETEILIGUNGEN - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ                                      |                        |                        |                      |  |  |   |                |  |             | KREDITRISIKO BETEILIGUNGEN - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ          |                                     |                    |                                       |  |                                  |                        |                      |   |
|---|------------------------|------------------------|----------------------|--|--|---|----------------|--|-------------|---|-------------------------------------|--------------------|---------------------------------------|--|----------------------------------|------------------------|----------------------|---|
| TEIL A  |                        |                        |                      |  | TEIL B   |   |                |  |             |   |                                     |                    |                                       |  |                                  |                        |                      |   |
|   | "Ratingstufe"<br><...> | 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 | Eigenmittelerfordernis | Zusatzinformationen: |   |
|   |                        | (PD)-Bandbreite        |                      | Ausfallswahrscheinlichkeit aufgrund BonitätsEinstufung (%) |  | Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen                   |                | Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken |             | Hievon außerbilanzielle Forderungen   | Hievon außerbilanzielle Forderungen | Erwarteter Verlust | Wertberichtigungen und Rückstellungen |  |                                  |                        |                      |   |
|   |                        | Untere PD-Grenze in %  | Obere PD-Grenze in % |  |  | Garantien   | Kreditderivate | Abflüsse (-)   | Zufüsse (+) |   |                                     |                    |                                       |  |                                  |                        |                      |   |
|   |                        | 1                      | 2                    |  |  | 3   | 4              | 5  | 6           |   |                                     |                    |                                       |  |                                  |                        | 7                    | 8 |
| <b>Summe IRB-Forderungsklasse Beteiligungen</b>   |                        |                        |                      |  |  |   |                |  |             |   |                                     |                    |                                       | 8514000  | 7712050                          | 8516000                | 8517000              |   |
| <b>1. PD/LGD-Ansatz: Summe</b>  |                        |                        |                      | 8504005  | 8505005  | 8506005   | 8507005        | 8508005  | 8509005     | 8510005   | 8511005                             | 8512005            | 8513005                               | 8514005  | 8515005                          |                        |                      |   |
| <b>Aufgliederung der Summenposition gemäß PD/LGD-Ansatz nach Ratingstufe</b>                              |                        |                        |                      |  |  |   |                |  |             |   |                                     |                    |                                       |  |                                  |                        |                      |   |
| Ratingstufe (a): 1  |                        |                        |                      |  |  |   |                |  |             |   |                                     |                    |                                       |  |                                  |                        |                      |   |
| 2   | <...>                  | 8501010                | 8502010              | 8503010  | 8504010  |   |                |  | 8509010     | 8510010   | 8511010                             | 8512010            | 8513010                               | 8514010  | 8515010                          |                        |                      |   |
| .....   |                        |                        |                      |  |  |   |                |  |             |   |                                     |                    |                                       |  |                                  |                        |                      |   |
| N   |                        |                        |                      |  |  |   |                |  |             |   |                                     |                    |                                       |  |                                  |                        |                      |   |
| <b>2. Einfacher risikogewichteter Ansatz: Summe</b>   |                        |                        |                      | 8504015  | 8505015  | 8506015   | 8507015        | 8508015  | 8509015     | 8510015   | 8511015                             | 8512015            |                                       | 8514015  | 8515015                          |                        |                      |   |
| <b>Aufgliederung der Summenposition gemäß dem einfachen risikogewichteten Ansatz nach Risikogewichten</b> |                        |                        |                      |  |  |   |                |  |             |   |                                     |                    |                                       |  |                                  |                        |                      |   |
| Risikogewicht: 190%   |                        |                        |                      | 8504020  |  |   |                |  | 8509020     | 8510020   | 8511020                             | 8512020            |                                       | 8514020  | 8515020                          |                        |                      |   |
| 290%  |                        |                        |                      | 8504025  |  |   |                |  | 8509025     | 8510025   | 8511025                             | 8512025            |                                       | 8514025  | 8515025                          |                        |                      |   |
| 370%  |                        |                        |                      | 8504030  |  |   |                |  | 8509030     | 8510030   | 8511030                             | 8512030            |                                       | 8514030  | 8515030                          |                        |                      |   |
| <b>3. Ansatz nach internem Modell</b>   |                        |                        |                      |  |  |   |                |  |             |   |                                     |                    |                                       | 8514035  | 8515035                          | 8517035                |                      |   |
| <b>4. Grandfathering</b>  |                        |                        |                      | 8504040  |  |   |                |  |             |   |                                     |                    |                                       | 8514040  | 8515040                          | 8517040                |                      |   |

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



**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 verlagender Techniken | Aus Eigenmittelerfordernis herausgerechneter erwarteter Verlust | Eigenmittel-erleichterung durch Risiko verlagende Techniken | Hievon: durch Versicherungen | Überschussbetrag anrechenbarer risiko-verlagender Techniken |
|  | 1               | 2       | 3       | 4   | 5                   | 6                    | 7                      | 8  | 9  | 9a  | 10  | 10a                          | 12  |
| <b>Basisindikatoransatz</b>  | 9001000         | 9002000 | 9003000 |   |                     |                      | 7741000                |  |  |   |   |                              |   |
| <b>Standardansatz (SA)/ Standardansatz (ASA)</b> <span style="float: right;">Alternativer</span> |                 |         |         |   |                     |                      | 7742000                |  |  |   |   |                              |   |
| <b>Standardansatz</b>  |                 |         |         |   |                     |                      |                        |  |  |   |   |                              |   |
| 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 |   |                     |                      |                        |  |  |   |   |                              |   |
| <b>Alternativer Standardansatz (ASA)</b>   |                 |         |         |   |                     |                      |                        |  |  |   |   |                              |   |
| Firmenkundengeschäft   | 9001045         | 9002045 | 9003045 | 9004045   | 9005045             | 9006045              |                        |  |  |   |   |                              |   |
| Privatkundengeschäft   | 9001050         | 9002050 | 9003050 | 9004050   | 9005050             | 9006050              |                        |  |  |   |   |                              |   |
| <b>Fortgeschrittener Messansatz (AMA)</b>  | 9001055         | 9002055 | 9003055 |   |                     |                      | 7743000                | 9008055  | 9009055  | 9010055   | 9011055   | 9012055                      | 9013055   |

**Kapitel "Positionen des Handelsbuchs"**

Periodizität: Vierteljährlich



|   |
|---|
| <b>MARKTRISIKO ZINSBEZOGENER INSTRUMENTE IM HANDELSBUCH (§ 205f SOLVAV)</b> |
|---|

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

|  |
|--|
| <b>MARKTRISIKO POSITIONSRIKIO IN SUBSTANZWERTEN GEMÄß § 207 SOLVAV</b> |
|--|

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

|                                     |
|-------------------------------------|
| <b>MARKTRISIKO ABWICKLUNGSRIKIO</b> |
|-------------------------------------|

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

**Kapitel "Fortsetzung Ordnungsnormen"**

Periodizität: Monatlich

|   |
|---|
| <b>HANDELSBUCH - §§ 22n bis 22q BWG</b> |
|---|

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

|  |
|--|
| <b>OFFENE DEISENPOSITIONEN GEMÄß § 22 Abs. 1 Z 3 und § 22o Abs. 2 Z 12 BWG</b> |
|--|

|   | <b>ISO-Code<sup>1</sup></b> | <b>Betrag</b> |
|---|-----------------------------|---------------|
| <b>1. Monatsendstand der offenen Deisenpositionen pro Währung</b>       | <_>                         | 6800000       |
| <b>2. Höchststand der offenen Deisenpositionen pro Währung im Monat</b> | <_>                         | 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.

|                        |
|------------------------|
| <b>INTERNE MODELLE</b> |
|------------------------|

|   | Durchschnitt der letzten 60 Tage x Multiplikator | Value at Risk des Vortages | Zuschlag für das spezifische Positionsrisiko | Zuschlag für das zusätzliche Ausfallsrisiko | Eigenmittelerfordernis | Zusatzinformation:   |               |
|---|--|----------------------------|--|---|------------------------|--|---------------|
|   |  |                            |  |   |                        | Anzahl der Überschreitungen (Ausnahmen) während der letzten 250 Tage | Multiplikator |
|   | 1  | 2                          | 3  | 4   | 5                      | 6  | 7             |
| <b>Gesamtpositionen</b>                                 | 5201000  | 5202000                    | 5203000                                      | 5204000                                     | 7732000                | 5206000  | 5207000       |
| Marktrisikokomponenten                                  |  |                            |  |   |                        |  |               |
| 1. zinsbezogene Instrumente                             | 5201005<br>(Summe)                               | 5202005<br>(Summe)         | 5203005                                      | 5204005                                     |                        |  |               |
| 1.1 zinsbez. Instrumente - Allgemeines Positionsrisiko  | 5201010  | 5202010                    |  |   |                        |  |               |
| 1.2 zinsbez. Instrumente - Spezifisches Positionsrisiko | 5201015  | 5202015                    |  |   |                        |  |               |
| 2. Substanzwerte  | 5201020<br>(Summe)                               | 5202020<br>(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**

| <b>1. Liquidität 1</b>   |                                      |
|--|--------------------------------------|
| <b>a) Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 7 Z 1 BWG (nur von Zentralinstituten auszufüllen)</b> | <b>Durchschnitt<sup>1</sup></b>      |
| Einlagen bei Zentralinstituten unter 30 Tagen (gemäß § 25 Abs. 4 Z 1 BWG)                        | 6311100                              |
| <b>b) Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 7 Z 2 BWG</b>   | <b>Durchschnitt<sup>2</sup></b>      |
| 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                              |
| <b>c) Flüssige Mittel 1. Grades gemäß § 25 Abs. 6 BWG</b>  | <b>Durchschnitt<sup>3</sup></b>      |
| <b>Summe</b>   | 6500100                              |
| <b>2. Liquidität 2</b>   |                                      |
| <b>a) Euro-Verpflichtungen gemäß § 25 Abs. 8 BWG</b>   | <b>15. des<br/>Berichtsmonats</b>    |
| 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                              |
| <b>Summe</b>   | 6602115                              |
| <b>b) Flüssige Mittel 2. Grades gemäß § 25 Abs. 10 und 11 BWG</b>                                | <b>Ultimo des<br/>Berichtsmonats</b> |
| 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                              |
| <b>Summe</b>   | 6702131                              |

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

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

<sup>3</sup> 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     |   |
|--------------|------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------|---|---------|---|---------|---|---------|-----------------------|-----------------------|---------------------|------------------|---|
| Identnummer  | GVA-Kennzeichen <sup>1</sup> | Veranlagung vor Risikovorsorge | GVA nach Abzug von Risikovorsorge | hievon Kategorien gemäß § 27 Abs. 2 BWG |         | Zurechnung gemäß § 27 Abs. 5 BWG zu einem Dritten |         | Kreditrisikomindernde Sicherheiten <sup>2</sup> - Zurechnung zu Vertragspartner |         | GVA nach Zurechnungen | Gewicht               | Un-gewichteter Wert | Gewichteter Wert | Vertraglich gebundener Wert nach Gewichtung |
|              |                              |                                |                                   |   |         | Identnummer                                       | Betrag  | Identnummer   | Betrag  |                       |                       |                     |                  |   |
| <...>        | 7410001                      | 7410002                        | 7410004                           | Aktivposten                             | 7410005 | <...>   | 7410009 | <...>   | 7410010 | 7410011               | mit 0%-Gewichtung     | 7410012             |                  |   |
|              |                              |                                |                                   |   |         |   |         |   |         |                       | mit 20%-Gewichtung    | 7410015             | 7410016          | 7410017                                     |
|              |                              |                                |                                   | Außerbilanzmäßige Geschäfte             | 7410006 |   |         |   |         |                       | mit 50%-Gewichtung    | 7410018             | 7410019          | 7410020                                     |
|              |                              |                                |                                   | Derivate                                | 7410007 |   |         |   |         |                       | mit 100%-Gewichtung   | 7410021             | 7410022          | 7410023                                     |
|              |                              |                                |                                   | Positionen des Handelsbuchs             | 7410008 |   |         |   |         |                       | mit anderen Gewichten | 7410024             | 7410025          | 7410026                                     |
|              |                              |                                |                                   |   |         |   |         |   |         |                       | Summe                 | 7410027             | 7410028          | 7410029                                     |

**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 |