

Anlage B1

Ordnungsnormenausweis für Kreditinstitutsgruppen gemäß § 1 ONA-V

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

Periodizität: Monatlich

CA-TEMPLATE konsolidiert

		Betrag
1	Eigenmittel insgesamt	7800800
1.1	Kernkapital	7810800
1.1.1	Zwischensumme Kapitalia	7811800
1.1.1*	hievon begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kernkapitalinstrumente	7811802
1.1.1**	hievon begrenzt anrechenbare, innovative Kernkapitalinstrumente	7811804
1.1.1.1	<i>Eingezahltes Kapital (Geschäfts-, Grund-, Stamm-, Dotationskapital und Geschäftsguthaben) ohne Vorzugsaktien mit Dividendennachzahlungspflicht</i>	7811806
1.1.1.2	<i>(-) Eigene Aktien oder Geschäftsanteile</i>	7811808
1.1.1.3	<i>Kapitalrücklage (Emissionsagiokonto)</i>	7811810
1.1.1.4	<i>Sonstige als eingezahltes Kapital anrechenbare Instrumente (z.B. unbefristete stille Beteiligungen)</i>	7811812
1.1.2	Sonstige anrechenbare Rücklagen	7812800
1.1.2*	hievon Haftrücklage	7812803
1.1.2.1	<i>Sonstige Rücklagen</i>	7812806
1.1.2.2	<i>Minderheitsbeteiligungen</i>	7812809
1.1.2.2*	hievon begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kapitalinstrumente	7812812
1.1.2.2**	hievon begrenzt anrechenbare, innovative Kapitalinstrumente	7812815
1.1.2.3	<i>Zwischengewinn</i>	7812818
1.1.2.4	<i>(-) Bilanzverlust sowie materielle negative Ergebnisse im laufenden Geschäftsjahr</i>	7812821
1.1.2.5	<i>(-) Nettogewinne aus der Kapitalisierung künftiger Erträge verbriefter Forderungen</i>	7812824
1.1.2.6	<i>Im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften (Prudential Filters)</i>	7812827
1.1.2.6.01	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten	7812830
1.1.2.6.02	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten	7812833
1.1.2.6.03	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Krediten und sonstigen Forderungen	7812836
1.1.2.6.04	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Krediten und sonstigen Forderungen	7812839
1.1.2.6.05	Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögensgegenständen	7812842
1.1.2.6.06	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögensgegenständen	7812845
1.1.2.6.07	Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf Finanzinstrumente (eigenes Kreditrisiko)	7812848
1.1.2.6.08	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf Finanzinstrumente (eigenes Kreditrisiko)	7812851
1.1.2.6.09	Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögensgegenständen dienen	7812854
1.1.2.6.10	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögensgegenständen dienen	7812857
1.1.2.6.11	Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien	7812860
1.1.2.6.12	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien	7812863
1.1.2.6.13	Bewertungseffekte aus selbstgenutztem Anlagevermögen	7812866
1.1.2.6.14	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbstgenutztem Anlagevermögen	7812869
1.1.2.6.15	Andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen	7812872
1.1.2.6.16	Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen	7812875
1.1.2.6.17	+/- Unterschiedsbetrag aus der Zusammenfassung von Eigenkapital und Beteiligungen	7812878
1.1.2.6.18	+/- Umrechnungsdifferenzen ausländischer	7812881

	Währungen	
1.1.2.6.19	+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung der nachgeordneten Institute	7812884
1.1.2.6.20	+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung von Beteiligungen an Unternehmen	7812887
1.1.3	Fonds für allgemeine Bankrisiken	7813800
1.1.4	Andere, landesspezifische Kernkapitalbestandteile	7814800
1.1.4.1	<i>Begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kernkapitalinstrumente</i>	7814802
1.1.4.2	<i>Begrenzt anrechenbare, innovative Kernkapitalinstrumente</i>	7814804
1.1.4.3	<i>Korrekturposten (positiv) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften</i>	7814806
1.1.4.4	<i>Sonstige Korrekturposten (positiv)</i>	7814808
1.1.5	(-) Sonstige Abzugspositionen vom Kernkapital	7815800
1.1.5.1	<i>(-) Immaterielle Vermögensgegenstände</i>	7815802
1.1.5.2	<i>(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze nicht innovativer Kernkapitalinstrumente (> 50% des Kernkapitals)</i>	7815804
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>	7815806
1.1.5.4	<i>(-) Andere, landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital</i>	7815808
1.1.5.4.1	<i>(-) Korrekturposten (negativ) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften</i>	7815810
1.1.5.4.2	<i>(-) Sonstige Korrekturposten (negativ)</i>	7815812
1.2	Ergänzende Eigenmittel	7820800
1.2.1	Zwischensumme I	7821800
1.2.1.1	<i>Als ergänzende Eigenmittel anrechenbare Kernkapitalbestandteile</i>	7821805
1.2.1.2	<i>Korrekturposten für aus dem Kernkapital übertragene Bewertungseffekte (Prudential Filters)</i>	7821810
1.2.1.2.01	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten</i>	7821815
1.2.1.2.02	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Vermögensgegenständen umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821820
1.2.1.2.03	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821825
1.2.1.2.04	<i>Korrekturposten aus selbstgenutztem Anlagevermögen umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821830
1.2.1.2.05	<i>Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen</i>	7821835
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>	7821840
1.2.1.4	<i>Sonstige ergänzende Eigenmittelkomponenten/Ergänzungskapital gemäß § 23 Abs. 1 Z 5 BWG</i>	7821845
1.2.1.5	<i>Berücksichtigungsfähiger Risikovorsorgeüberschuss für IRB-Positionen</i>	7821850
1.2.1.6	<i>Landesspezifische ergänzende Eigenmittelbestandteile höherer Qualität</i>	7821855
1.2.1.6.1	<i>Stille Reserven</i>	7821860
1.2.1.6.2	<i>Partizipationskapital mit Dividendennachzahlungspflicht</i>	7821865
1.2.1.7	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 4 BWG</i>	7821870
1.2.2	Zwischensumme II	7822800
1.2.2.1	<i>Haftsummenzuschläge</i>	7822805
1.2.2.2	<i>Kumulative Vorzugsaktien mit fester Laufzeit</i>	7822810
1.2.2.3	<i>Langfristiges nachrangiges Kapital</i>	7822815
1.2.2.4	<i>Landesspezifische ergänzende Eigenmittelbestandteile niedriger Qualität</i>	7822820
1.2.2.5	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 3 BWG</i>	7822825
1.2.2.6	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 6 BWG</i>	7822830
1.2.3	(-) Abzugspositionen von der Summe der ergänzenden Eigenmittel	7823800
1.2.3.1	<i>(-) Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 2 BWG</i>	7823805
1.2.3.2	<i>(-) Andere, landesspezifische Abzugspositionen von der Summe der ergänzenden Eigenmittel</i>	7823810
1.3	(-) Abzugspositionen vom Kernkapital und von ergänzenden Eigenmittel	7830800

1.3.T1*	<i>hievon (-) vom Kernkapital</i>	7830802
1.3.T2*	<i>hievon (-) von ergänzenden Eigenmittel</i>	7830804
1.3.1	(-) Anteile an anderen Kredit- und Finanzinstituten von mehr als 10% ihres Kapitals	7830806
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	7830808
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 zusammengenommen mehr als 10% der Eigenmittel des Kreditinstitutes übersteigen	7830810
1.3.4	(-) Beteiligungen an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften	7830812
1.3.5	(-) Sonstige Kapitalbestandteile an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften	7830814
1.3.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital und von ergänzenden Eigenmittel	7830816
1.3.7	(-) Verbriefungspositionen, auf die ein Risikogewicht von 1250% angewandt wird und die bei der Ermittlung der risikogewichteten Aktiva nicht berücksichtigt worden sind	7830818
1.3.8	(-) Risikovorsorge-Fehlbeträge für IRB-Positionen	7830820
1.4	<i>Anrechenbares Kernkapital (nach Abzugsposten)</i>	7810801
1.5	<i>Anrechenbare ergänzende Eigenmittel (nach Abzugsposten)</i>	7830801
1.6	Anrechenbares Kernkapital und anrechenbare ergänzende Eigenmittel (nach Abzugsposten)	7850801
1.7	<i>Tier III-Kapital</i>	7840800
1.7.1	Zur Umwidmung in Tier III-Kapital zur Verfügung stehendes Tier II-Kapital	7840805
1.7.2	Nettogewinn aus dem Handelsbuch	7840810
1.7.3	Kurzfristiges nachrangiges Kapital	7840815
1.7.4	(-) Illiquide Aktiva	7840820
1.7.5	Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 7 BWG	7840825
1.7.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Tier III-Kapital	7840830
1.7.7	(-) Ungenutztes, aber anrechenbares Tier III-Kapital	7840835
1.8	ZUSATZINFORMATIONEN:	
1.8.1	<i>Auf interne Ratings basierender Ansatz -Risikovorsorgen Überschuss (+)/Fehlbetrag (-)</i>	7850815
1.8.1.1	<i>Höhe der IRB-Risikovorsorgen</i>	7850820
1.8.1.1*	<i>hievon Pauschalwertberichtigungen</i>	7850825
1.8.1.1**	<i>Einzelwertberichtigungen</i>	7850830
1.8.1.1***	<i>Rückstellungen</i>	7850835
1.8.1.2	<i>(-) IRB-Ermittlung des erwarteten Verlustes</i>	7850840
1.8.2	Vorhandene Nachrangkapitalia gemäß § 23 Abs. 14 Z 5 BWG	7850845
1.9	Wert des Fondsvermögens gemäß § 3 Abs. 4 BWG	7850850
1.10	Eigenmittel-Basis für Großveranlagungen gemäß § 27 BWG	7850855
2	Gesamteigenmittelerfordernis	7700800
2.1	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Kreditrisiko gemäß §§ 22a bis 22h BWG	7710800
2.1*	<i>hievon Kontrahentenausfallsrisiko aus dem Handelsbuch</i>	7710801
2.1.1	Standardansatz (SA)	7711800
2.1.1.1a	<i>Standardansatz-Forderungsklassen (ohne Berücksichtigung von Verbriefungspositionen)</i>	7711803
2.1.1.1a.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7711806
2.1.1.1a.02	Forderungen an regionale Gebietskörperschaften	7711809
2.1.1.1a.03	Forderungen an Verwaltungseinrichtungen und Unternehmen ohne Erwerbscharakter im Besitz von Gebietskörperschaften	7711812
2.1.1.1a.04	Forderungen an multilaterale Entwicklungsbanken	7711815
2.1.1.1a.05	Forderungen an internationale Organisationen	7711818
2.1.1.1a.06	Forderungen an Institute	7711821
2.1.1.1a.07	Forderungen an Unternehmen	7711824
2.1.1.1a.08	Retail-Forderungen	7711827
2.1.1.1a.09	Durch Immobilien besicherte Forderungen	7711830
2.1.1.1a.10	Überfällige Forderungen	7711833
2.1.1.1a.11	Forderungen mit hohem Risiko	7711836
2.1.1.1a.12	Forderungen in Form von gedeckten Schuldverschreibungen	7711839

2.1.1.1a.13	Kurzfristige Forderungen an Institute und Unternehmen	7711842
2.1.1.1a.14	Forderungen in Form von Investmentfondsanteilen	7711845
2.1.1.1a.15	Sonstige Posten	7711848
2.1.1.2	Verbriefungspositionen - Standardansatz	7711860
2.1.2	Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRB)	7712800
2.1.2.1	Auf internen Ratings basierender Ansatz - ohne eigene LGD-Schätzung/Anwendung von Umrechnungsfaktoren	7712805
2.1.2.1.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7712810
2.1.2.1.02	Forderungen an Institute	7712815
2.1.2.1.03	Forderungen an Unternehmen	7712820
2.1.2.2	IRB-Ansatz - mit eigenen LGD-Schätzung/Anwendung von Umrechnungsfaktoren	7712825
2.1.2.2.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7712830
2.1.2.2.02	Forderungen an Institute	7712835
2.1.2.2.03	Forderungen an Unternehmen	7712840
2.1.2.2.04	Retail-Forderungen	7712845
2.1.2.3	Beteiligungspositionen IRB	7712850
2.1.2.4	Verbriefungspositionen IRB	7712855
2.1.2.5	Sonstige Forderungen	7712860
2.2	ABWICKLUNGSRISIKO	7720800
2.3	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko	7730800
2.3.1	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko (Standardansatz)	7731800
2.3.1.a	hievon nicht-lineare Risiken	7731805
2.3.1.b	hievon Szenario-Matrixmethode gemäß § 22e Abs. 3 BWG	7731810
2.3.1.1	Positionsrisiko in Schuldtiteln	7731815
2.3.1.2	Positionsrisiko in Substanzwerte	7731820
2.3.1.3	Risiko in Fremdwährungspositionen	7731825
2.3.1.4	Risiko in Warenpositionen	7731830
2.3.2	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko (Internes Modell)	7732800
2.4	EIGENMITTELERFORDERNIS für Operationelles Risiko	7740800
2.4.1	Operationelles Risiko Basisindikatoransatz	7741800
2.4.2	Operationelles Risiko Standardansatz/Alternativer Standardansatz	7742800
2.4.3	Operationelles Risiko Fortgeschrittener Messansatz	7743800
2.5	EIGENMITTELERFORDERNISSE resultierend aus dem Umstieg auf Basel II-Bestimmungen und sonstige Eigenmittelerfordernisse	7750800
2.5.1	Erfordernis aus Mindesteigenmitteluntergrenze aus dem Umstieg auf Basel II (Floor)	7751800
2.5.2	Eigenmittelerfordernis für qualifizierte Nichtfinanzbeteiligungen	7751805
2.5.3	Zusätzliches Eigenmittelerfordernis gemäß § 3 Abs. 4 BWG – (nur von KAG zu melden)	7751810
2.5.4	Gesamteigenmittelerfordernis bei Anwendung von § 103e Z 7 BWG im Rahmen des Roll-out gemäß § 21a Abs. 7 BWG	7751815
3	ZUSATZINFORMATIONEN:	
3.1	Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln (vor Berücksichtigung sonstiger Eigenmittelerfordernisse resultierend aus dem Umstieg auf die Basel II-Bestimmungen)	7610800
3.1.a	Capital ratio (in %); (vor Berücksichtigung sonstiger Eigenmittelerfordernisse resultierend aus dem Umstieg auf die Basel II-Bestimmungen)	7610805
3.2	Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln	7620800
3.2.a	Capital ratio (in %)	7620805
3.3	Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln unter Berücksichtigung des aufsichtlichen Überprüfungsprozesses	7630800
3.3.a	Capital index ratio (in %) unter Berücksichtigung des aufsichtlichen Überprüfungsprozesses	7630805
3.4	Interne Bewertung Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln	7640800
3.4.1	Interne Bewertung der anrechenbaren Eigenmittel	7641800
3.4.2	Interne Bewertung des Eigenmittelerfordernisses	7642800

CA-TEMPLATE sektorkonsolidiert

		Betrag
1	Eigenmittel insgesamt	7800900
1.1	Kernkapital	7810900
1.1.1	Zwischensumme Kapitalia	7811900
1.1.1*	hievon begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kernkapitalinstrumente	7811902
1.1.1**	hievon begrenzt anrechenbare, innovative Kernkapitalinstrumente	7811904
1.1.1.1	Eingezahltes Kapital (Geschäfts-, Grund-, Stamm-, Dotationskapital und Geschäftsguthaben) ohne Vorzugsaktien mit Dividendennachzahlungspflicht	7811906
1.1.1.2	(-) Eigene Aktien oder Geschäftsanteile	7811908
1.1.1.3	Kapitalrücklage (Emissionsagiokonto)	7811910
1.1.1.4	Sonstige als eingezahltes Kapital anrechenbare Instrumente (z.B. unbefristete stille Beteiligungen)	7811912
1.1.2	Sonstige anrechenbare Rücklagen	7812900
1.1.2*	hievon Haftrücklage	7812903
1.1.2.1	Sonstige Rücklagen	7812906
1.1.2.2	Minderheitsbeteiligungen	7812909
1.1.2.2*	hievon begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kapitalinstrumente	7812912
1.1.2.2**	hievon begrenzt anrechenbare, innovative Kapitalinstrumente	7812915
1.1.2.3	Zwischengewinn	7812918
1.1.2.4	(-) Bilanzverlust sowie materielle negative Ergebnisse im laufenden Geschäftsjahr	7812921
1.1.2.5	(-) Nettogewinne aus der Kapitalisierung künftiger Erträge verbriefteter Forderungen	7812924
1.1.2.6	Im Kernkapital zu berücksichtigende Effekte aus bestimmten Bewertungsvorschriften (Prudential Filters)	7812927
1.1.2.6.01	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten	7812930
1.1.2.6.02	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten	7812933
1.1.2.6.03	Bewertungseffekte aus Available for Sale-Krediten und sonstigen Forderungen	7812936
1.1.2.6.04	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Krediten und sonstigen Forderungen	7812939
1.1.2.6.05	Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögensgegenständen	7812942
1.1.2.6.06	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus sonstigen Available for Sale-Vermögensgegenständen	7812945
1.1.2.6.07	Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf Finanzinstrumente (eigenes Kreditrisiko)	7812948
1.1.2.6.08	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus der Anwendung der Fair Value Option auf Finanzinstrumente (eigenes Kreditrisiko)	7812951
1.1.2.6.09	Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögensgegenständen dienen	7812954
1.1.2.6.10	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus cash flow hedges, die nicht zur Absicherung von Available for Sale-Vermögensgegenständen dienen	7812957
1.1.2.6.11	Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien	7812960
1.1.2.6.12	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltenen Immobilien	7812963
1.1.2.6.13	Bewertungseffekte aus selbstgenutztem Anlagevermögen	7812966
1.1.2.6.14	Korrekturposten für Bewertungseffekte aus selbstgenutztem Anlagevermögen	7812969
1.1.2.6.15	Andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen	7812972
1.1.2.6.16	Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen	7812975
1.1.2.6.17	+/- Unterschiedsbetrag aus der Zusammenfassung von Eigenkapital und Beteiligungen	7812978
1.1.2.6.18	+/- Umrechnungsdifferenzen ausländischer Währungen	7812981
1.1.2.6.19	+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung der nachgeordneten Institute	7812984
1.1.2.6.20	+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung von Beteiligungen an Unternehmen	7812987
1.1.3	Fonds für allgemeine Bankrisiken	7813900
1.1.4	Andere, landesspezifische Kernkapitalbestandteile	7814900
1.1.4.1	Begrenzt anrechenbare, nicht innovative Kernkapitalinstrumente	7814902

1.1.4.2	<i>Begrenzt anrechenbare, innovative Kernkapitalinstrumente</i>	7814904
1.1.4.3	<i>Korrekturposten (positiv) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften</i>	7814906
1.1.4.4	<i>Sonstige Korrekturposten (positiv)</i>	7814908
1.1.5	(-) Sonstige Abzugspositionen vom Kernkapital	7815900
1.1.5.1	<i>(-) Immaterielle Vermögensgegenstände</i>	7815902
1.1.5.2	<i>(-) Korrekturposten für die Überschreitung der Anrechnungsgrenze nicht innovativer Kernkapitalinstrumente (> 50% des Kernkapitals)</i>	7815904
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>	7815906
1.1.5.4	<i>(-) Andere, landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital</i>	7815908
1.1.5.4.1	<i>(-) Korrekturposten (negativ) für die erstmalige Anwendung internationaler Rechnungslegungsvorschriften</i>	7815910
1.1.5.4.2	<i>(-) Sonstige Korrekturposten (negativ)</i>	7815912
1.2	<i>Ergänzende Eigenmittel</i>	7820900
1.2.1	<i>Zwischensumme I</i>	7821900
1.2.1.1	<i>Als Ergänzende Eigenmittel anrechenbare Kernkapitalbestandteile</i>	7821905
1.2.1.2	<i>Korrekturposten für aus dem Kernkapital übertragene Bewertungseffekte (Prudential Filters)</i>	7821910
1.2.1.2.01	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Eigenkapitalinstrumenten</i>	7821915
1.2.1.2.02	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus Available for Sale-Vermögensgegenständen umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821920
1.2.1.2.03	<i>Korrekturposten für Bewertungseffekte aus als Finanzinstrumente gehaltene Immobilien umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821925
1.2.1.2.04	<i>Korrekturposten aus selbstgenutztem Anlagevermögen umgewandelt in ergänzende Eigenmittel</i>	7821930
1.2.1.2.05	<i>Korrekturposten für andere Bewertungseffekte, die die sonstigen anrechenbaren Rücklagen betreffen</i>	7821935
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>	7821940
1.2.1.4	<i>Sonstige ergänzende Eigenmittelkomponenten/Ergänzungskapital gemäß § 23 Abs. 1 Z 5 BWG</i>	7821945
1.2.1.5	<i>Berücksichtigungsfähiger Risikovorsorgeüberschuss für IRB-Positionen</i>	7821950
1.2.1.6	<i>Landesspezifische ergänzende Eigenmittelbestandteile höherer Qualität</i>	7821955
1.2.1.6.1	<i>Stille Reserven</i>	7821960
1.2.1.6.2	<i>Partizipationskapital mit Dividendennachzahlungspflicht</i>	7821965
1.2.1.7	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 4 BWG</i>	7821970
1.2.2	<i>Zwischensumme II</i>	7822900
1.2.2.1	<i>Haftsummenzuschläge</i>	7822905
1.2.2.2	<i>Kumulative Vorzugsaktien mit fester Laufzeit</i>	7822910
1.2.2.3	<i>Langfristiges nachrangiges Kapital</i>	7822915
1.2.2.4	<i>Landesspezifische ergänzende Eigenmittelbestandteile niedriger Qualität</i>	7822920
1.2.2.5	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 3 BWG</i>	7822925
1.2.2.6	<i>Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 6 BWG</i>	7822930
1.2.3	(-) Abzugspositionen von der Summe der ergänzenden Eigenmittel	7823900
1.2.3.1	<i>(-) Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 2 BWG</i>	7823905
1.2.3.2	<i>(-) Andere, landesspezifische Abzugspositionen von der Summe der ergänzenden Eigenmittel</i>	7823910
1.3	(-) Abzugspositionen vom Kernkapital und von ergänzenden Eigenmittel	7830900
1.3.T1*	<i>hievon (-) vom Kernkapital</i>	7830902
1.3.T2*	<i>hievon (-) von ergänzenden Eigenmittel</i>	7830904
1.3.1	(-) Anteile an anderen Kredit- und Finanzinstituten von mehr als 10% ihres Kapitals	7830906
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	7830908
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 zusammengenommen	7830910

	mehr als 10% der Eigenmittel des Kreditinstitutes übersteigen	
1.3.4	(-) Beteiligungen an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften	7830912
1.3.5	(-) Sonstige Kapitalbestandteile an Versicherungsunternehmen, Rückversicherungsunternehmen und Versicherungsholdinggesellschaften	7830914
1.3.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Kernkapital und von ergänzenden Eigenmitteln	7830916
1.3.7	(-) Verbriefungspositionen, auf die ein Risikogewicht von 1250% angewandt wird und die bei der Ermittlung der risikogewichteten Aktiva nicht berücksichtigt worden sind	7830918
1.3.8	(-) Risikovorsorge-Fehlbeträge für IRB-Positionen	7830920
1.4	Anrechenbares Kernkapital (nach Abzugsposten)	7810901
1.5	Anrechenbare ergänzende Eigenmittel (nach Abzugsposten)	7830901
1.6	Anrechenbares Kernkapital und anrechenbare ergänzende Eigenmittel (nach Abzugsposten)	7850901
1.7	Tier III-Kapital	7840900
1.7.1	Zur Umwidmung in Tier III-Kapital zur Verfügung stehendes Tier II-Kapital	7840905
1.7.2	Nettogewinn aus dem Handelsbuch	7840910
1.7.3	Kurzfristiges nachrangiges Kapital	7840915
1.7.4	(-) Illiquide Aktiva	7840920
1.7.5	Korrekturposten gemäß § 23 Abs. 14 Z 7 BWG	7840925
1.7.6	(-) Landesspezifische Abzugspositionen vom Tier III-Kapital	7840930
1.7.7	(-) Ungenutztes, aber anrechenbares Tier III-Kapital	7840935
1.8	ZUSATZINFORMATIONEN:	7850915
1.8.1	Auf interne Ratings basierender Ansatz -Risikovorsorgen Überschuss (+)/Fehlbetrag (-)	
1.8.1.1	<i>Höhe der IRB-Risikovorsorgen</i>	7850920
1.8.1.1*	<i>hievon Pauschalwertberichtigungen</i>	7850925
1.8.1.1**	<i>Einzelwertberichtigungen</i>	7850930
1.8.1.1***	<i>Rückstellungen</i>	7850935
1.8.1.2	<i>(-) IRB-Ermittlung des erwarteten Verlustes</i>	7850940
1.8.2	Vorhandene Nachrangkapitalia gemäß § 23 Abs. 14 Z 5 BWG	7850945
1.9	Wert des Fondsvermögens gemäß § 3 Abs. 4 BWG	7850950
1.10	Eigenmittel-Basis für Großveranlagungen gemäß § 27 BWG	7850955
2	Gesamteigenmittelerfordernis	7700900
2.1	EIGENMITTELERFORDERNIS für das Kreditrisiko gemäß §§ 22a bis 22h BWG	7710900
2.1*	hievon Kontrahentenausfallsrisiko aus dem Handelsbuch	7710901
2.1.1	Standardansatz (SA)	7711900
2.1.1.1a	Standardansatz-Forderungsklassen (ohne Berücksichtigung von Verbriefungspositionen)	7711903
2.1.1.1a.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7711906
2.1.1.1a.02	Forderungen an regionale Gebietskörperschaften	7711909
2.1.1.1a.03	Forderungen an Verwaltungseinrichtungen und Unternehmen ohne Erwerbscharakter im Besitz von Gebietskörperschaften	7711912
2.1.1.1a.04	Forderungen an multilaterale Entwicklungsbanken	7711915
2.1.1.1a.05	Forderungen an internationale Organisationen	7711918
2.1.1.1a.06	Forderungen an Institute	7711921
2.1.1.1a.07	Forderungen an Unternehmen	7711924
2.1.1.1a.08	Retail-Forderungen	7711927
2.1.1.1a.09	Durch Immobilien besicherte Forderungen	7711930
2.1.1.1a.10	Überfällige Forderungen	7711933
2.1.1.1a.11	Forderungen mit hohem Risiko	7711936
2.1.1.1a.12	Forderungen in Form von gedeckten Schuldverschreibungen	7711939
2.1.1.1a.13	Kurzfristige Forderungen an Institute und Unternehmen	7711942
2.1.1.1a.14	Forderungen in Form von Investmentfondsanteilen	7711945
2.1.1.1a.15	Sonstige Posten	7711948
2.1.1.2	Verbriefungspositionen - Standardansatz	7711960
2.1.2	Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRB)	7712900
2.1.2.1	Auf internen Ratings basierender Ansatz - ohne eigene LGD-Schätzung/Anwendung von Umrechnungsfaktoren	7712905

2.1.2.1.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7712910
2.1.2.1.02	Forderungen an Institute	7712915
2.1.2.1.03	Forderungen an Unternehmen	7712920
2.1.2.2	<i>IRB-Ansatz - mit eigener LGD-Schätzung/Anwendung von Umrechnungsfaktoren</i>	7712925
2.1.2.2.01	Forderungen an Zentralstaaten und Zentralbanken	7712930
2.1.2.2.02	Forderungen an Institute	7712935
2.1.2.2.03	Forderungen an Unternehmen	7712940
2.1.2.2.04	Retail-Forderungen	7712945
2.1.2.3	<i>Beteiligungspositionen IRB</i>	7712950
2.1.2.4	<i>Verbriefungspositionen IRB</i>	7712955
2.1.2.5	<i>Sonstige Forderungen</i>	7712960
2.2	<i>ABWICKLUNGSRISIKO</i>	7720900
2.3	<i>EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko</i>	7730900
2.3.1	<i>EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko (Standardansatz)</i>	7731900
2.3.1.a	<i>hievon nicht-lineare Risiken</i>	7731905
2.3.1.b	<i>hievon Szenario-Matrixmethode gemäß § 22e Abs. 3 BWG</i>	7731910
2.3.1.1	<i>Positionsrisiko in Schuldtiteln</i>	7731915
2.3.1.2	<i>Positionsrisiko in Substanzwerte</i>	7731920
2.3.1.3	<i>Risiko in Fremdwährungspositionen</i>	7731925
2.3.1.4	<i>Risiko in Warenpositionen</i>	7731930
2.3.2	<i>EIGENMITTELERFORDERNIS für das Positionsrisiko in Schuldtiteln und Substanzwerten, Fremdwährungs- und Warenpositionsrisiko (Internes Modell)</i>	7732900
2.4	<i>EIGENMITTELERFORDERNIS für Operationelles Risiko</i>	7740900
2.4.1	<i>Operationelles Risiko Basisindikatoransatz</i>	7741900
2.4.2	<i>Operationelles Risiko Standardansatz/Alternativer Standardansatz</i>	7742900
2.4.3	<i>Operationelles Risiko Fortgeschrittener Messansatz</i>	7743900
2.5	<i>EIGENMITTELERFORDERNISSE resultierend aus dem Umstieg auf Basel II-Bestimmungen und sonstige Eigenmittelerfordernisse</i>	7750900
2.5.1	<i>Erfordernis aus Mindesteigenmitteluntergrenze aus dem Umstieg auf Basel II (Floor)</i>	7751900
2.5.2	<i>Eigenmittelerfordernis für qualifizierte Nichtfinanzbeteiligungen</i>	7751905
2.5.3	<i>Zusätzliches Eigenmittelerfordernis gemäß § 3 Abs. 4 BWG – (nur von KAG zu melden)</i>	7751910
3	<i>ZUSATZINFORMATIONEN:</i>	
3.1	<i>Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln (vor Berücksichtigung sonstiger Eigenmittelerfordernisse resultierend aus dem Umstieg auf die Basel II-Bestimmungen)</i>	7610900
3.1.a	<i>Capital ratio (in %); (vor Berücksichtigung sonstiger Eigenmittelerfordernisse resultierend aus dem Umstieg auf die Basel II-Bestimmungen)</i>	7610905
3.2	<i>Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln</i>	7620900
3.2.a	<i>Capital ratio (in %)</i>	7620905
3.3	<i>Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln unter Berücksichtigung des aufsichtlichen Überprüfungsprozesses</i>	7630900
3.3.a	<i>Capital index ratio (in %) unter Berücksichtigung des aufsichtlichen Überprüfungsprozesses</i>	7630905
3.4	<i>Interne Bewertung Überschuss (+)/Fehlbetrag (-) an anrechenbaren Eigenmitteln</i>	7640900
3.4.1	<i>Interne Bewertung der anrechenbaren Eigenmittel</i>	7641900
3.4.2	<i>Interne Bewertung des Eigenmittelerfordernisses</i>	7642900

EIGENMITTELVERWENDUNGSRECHNUNG

Eigenmittelkategorien	Freies Kapital (abzüglich Eigenmittel- erfordernisse 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 "Detailinformationen zu Eigenmittel und Solvabilität über die Kreditinstitutsgruppe gemäß § 30 BWG"

Periodizität: Vierteljährlich

Detailinformationen zu Eigenmittel und Solvabilität über die Kreditinstitutsgruppe gemäß § 30 BWG

Kreditinstitutsgruppen-Mitglieder und verbundene Unternehmen										Beitrag zur Kreditinstitutsgruppen-Solvabilität BWG		
Name	Identnummer <...>	Eigenmittel- erfordernis- Kreditrisiko	Abwicklungs- risiko	Eigenmittel- erfordernis für das Positions-, Fremdwährungs- und Warenpositions- risiko	Eigenmittel- erfordernis für das Operationelle Risiko	Sonstige Eigenmittel- erfordernisse resultierend aus dem Umstieg auf Basel II- Bestimmungen	Gesamt- eigenmittel- erfordernis	Eigenmittel insgesamt	Kernkapital (nach Abzugs- posten)	Überschuss (+)/ Fehlbetrag (-) an Eigenmittel	Eigenmittel	Eigenmittel- erfordernis
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11=9-8	13	14
7610000	< ... >	7620000	7630000	7640000	7650000	7660000	7670000	7680000	7690000	7700000	7700100	7700200

Kapitel "Kreditrisiko-Standardansatz"

Periodizität: Vierteljährlich

KREDITRISIKO-STANDARDANSATZ

TEIL A

SA Forderungsklasse:

< ... >

TEIL B

KREDITRISIKO-STANDARDANSATZ

	Bruttoforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsfaktoren				Kreditrisikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten						Nettobforderung 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*)	Aufgliederung des vollständig angepassten Forderungswertes bei außerbilanziellen Geschäften durch Umrechnungsfaktoren (Credit Conversion Factors, CF)				Forderungswert	Risikogewichteter Forderungswert	Eigenmittelerfordernis				
	1	2	3	4=1-3	Sicherheiten ohne Sicherheitenleistungen (Ga)		Sicherheiten mit Sicherheitenleistungen		Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken			12	13	14		15=11+12+13	16	17	18				19	20=15-16-0,8*17-0,5*18	21	22
					Garantien	Krediterivate	Finanzielle Sicherheiten	Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitenleistungen	Ablässe (-)	Zuflüsse (+)																
Summe Forderungen	7701000	7702000	7703000	7704000	7705000	7706000	7707000	7708000	7709000	7710000	7712001	7713000	7714000	7715000	7716000	7717000	7718000	7719000	7720000	7721000	7722000	7711800				

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 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																												
hypothekarisch besichert (Gewerbliche Immobilien)	7701060		7703060	7704060																			7716060			7721060	7722060	7711060
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 rationalem 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 Forderungskategorie: < ... >

	Bauforderung vor Berücksichtigung von Umrechnungsfaktoren		Wertberichtigungen und Rückstellungen	Nettoforderung	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 unlässigen Methode			Aufgliederung des angepassten Forderungswertes bei außerbilanziellen Geschäften durch Umrechnungsfaktoren (Credit Conversion Factors; CF)				Forderungswert	Risikogewichteter Forderungswert	Eigenmittelforderung	
	Haben Kontaherenausfallrisiko	Garantien			Kreditorivate	Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen (Ga)		Sicherheiten mit Sicherheitsleistungen		Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikomindernden Techniken		Angepasster Wert der Forderung (E ¹)	0%	20%	50%	100%						
						Finanzielle Sicherheiten	Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitsleistungen	Ablässe (-)	Zulasse (+)	Volatilitätsanpassung des Forderungswertes (He)							Angepasster Wert der finanziellen Sicherheit (C _{max}) (-)	Volatilitäts- und Laufzeitanpassungen (L)				
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	
Summe Forderungen	7701000	7702000	7703000	7704000	7705000	7706000	7707000	7708000	7709000	7710000	7712001	7713000	7714000	7715000	7716000	7717000	7718000	7719000	7720000	7721000	7722000	7711800

Aufgliederung der Summenposition nach Forderungskategorien

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

Aufgliederung der Summenposition nach Risikogewichten

0%	7701030	7721030	7722030
10%	7701035	7721035	7722035
20%	7701040	7721040	7722040
35%	7701045	7721045	7722045
50%	7701050	7721050	7722050
ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur			
hypothekensicher (Gewerbliche Immobilien)	7701060	7721060	7722060
75%	7701065	7721065	7722065
100%	7701070	7721070	7722070
ohne externe Beurteilung einer anerkannten Ratingagentur			
hypothekensicher (Gewerbliche Immobilien)	7701080	7721080	7722080
150%	7701085	7721085	7722085
200%	7701089	7721089	7722089
Andere Risikogewichte nach nationalem Ermessen	7701095	7721095	7722095

¹ Werden Kreditinstitute und Kreditinstitutsgruppen den Kreditrisiko-Standardansatz an und legt 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 Werden Kreditinstitute und Kreditinstitutsgruppen den Kreditrisiko-Standardansatz an und legt 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.

KRENTSRISIKO VERBRIEFUNGEN - STANDARDANSATZ															KRENTSRISIKO VERBRIEFUNGEN - STANDARDANSATZ															KRENTSRISIKO VERBRIEFUNGEN - STANDARDANSATZ														
TEL A															TEL B															TEL C														
VERBRIEFUNGSTYP:															SUMMETRAFOINREINSTRICH															K... ..														
Summe der verbrieften Forderungen (signiert/amtlich)	Synthetische Verbriefungen: Bezeichnung der verbrieften Forderung				Verbriefungspositionen	Umschichtungen und Rückstellungen	Forderungen nach Verbuchungsregeln und Rückstellungen	Kreditrisikominimierende Techniken mit Substitutionsfunktionen					Aufgliederung des vollständig eingereichten Forderungsbetrags (2) in aufzubewahrende Geschäfte (nach Umschichtungsplanen)	Forderungswert	Aufbaukennung der Verbriefungspositionen gemäß Risikogewichten										Risikogewichtete Forderungspositionen	Eigenes Risiko nach "CAP"	Zulassung der Kapitalbindung entsprechend dem Maßstab von der SA. Verbriefung zu anderen Forderungsbeträgen	Eigenes Risiko nach "CAP"																
	Sicherheiten mit Substitutionsfunktionen (Cvent) (1)	Summe Adressen (1)	Sicherheiten ohne Substitutionsfunktionen (Kapitalwert/GK)	Kontingenz der Ausfallrisikoprüfung einschließlich Kreditbeurteilung				Substitutions der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditrisikominimierenden Techniken	Nachforderung nach Substitutionsfunktion durch kreditrisikominimierende Techniken	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfunktionen (Sb-Angewandter Wert)	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten ohne Substitutionsfunktionen (Sb-Angewandter Wert)	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfunktionen (Sb-angewandter Wert)			Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten ohne Substitutionsfunktionen (Sb-angewandter Wert)	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfunktionen (Sb-angewandter Wert)	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten ohne Substitutionsfunktionen (Sb-angewandter Wert)	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfunktionen (Sb-angewandter Wert)	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten ohne Substitutionsfunktionen (Sb-angewandter Wert)	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfunktionen (Sb-angewandter Wert)	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten ohne Substitutionsfunktionen (Sb-angewandter Wert)	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten mit Substitutionsfunktionen (Sb-angewandter Wert)	Kreditrisikominimierende Techniken in Form von Sicherheiten ohne Substitutionsfunktionen (Sb-angewandter Wert)	Mit Rating (Baukategorie 1 bis 6)					125%					Transparentmethode										
																								0%					>0 und <=30	>30 und <=60	>60 und <=100	20%	50%	100%	30%	Mit Rating	Ohne Rating	Mit Rating	Ohne Rating	Mit Rating	Ohne Rating	Mit Rating	Ohne Rating	Mit 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	30	31	32	33												
Summe Forderungen	710010	710020	710030	710040	710050	710060	710070	710080	710090	710100	710110	710120	710130	710140	710150	710160	710170	710180	710190	710200	710210	710220	710230	710240	710250	710260	710270	710280	710290	710300	710310	710320	710330	710340	710350									
Originär: Summe Forderungen	710010	710020	710030	710040	710050	710060	710070	710080	710090	710100	710110	710120	710130	710140	710150	710160	710170	710180	710190	710200	710210	710220	710230	710240	710250	710260	710270	710280	710290	710300	710310	710320	710330	710340	710350									
Bilanzielle Forderungen	710010	710020	710030	710040	710050	710060	710070							710410					710410																									
Mittel Sektor	710015	710025	710035	710045	710055	710065	710075							710415					710415																									
Messzone	710020	710030	710040	710050	710060	710070								710420					710420																									
Finanz Loss	710025	710035	710045	710055	710065	710075								710425					710425																									
Außerbilanzielle Forderungen und Derivate	710030	710040	710050	710060	710070									710430					710430																									
Kasse über vorläufige Rücklage	710033	710043	710053	710063	710073									710433					710433																									
Investor: Summe Forderungen	710035	710045	710055	710065	710075		710085	710095	710105	710115	710125	710135	710145	710155	710165	710175	710185	710195	710205	710215	710225	710235	710245	710255	710265	710275	710285	710295	710305	710315	710325	710335	710345	710355										
Bilanzielle Forderungen	710040	710050	710060											710440					710440																									
Mittel Sektor	710045	710055	710065											710445					710445																									
Messzone	710050	710060	710070											710450					710450																									
Finanz Loss	710055	710065	710075											710455					710455																									
Außerbilanzielle Forderungen und Derivate	710060	710070												710460	710150	710160	710170	710180	710460	710200	710210	710220	710230	710240	710250	710260	710270	710280	710290	710300	710310	710320	710330	710340	710350									
Investor: Summe Forderungen	710065	710075					710085	710095	710105	710115	710125	710135	710145	710155	710165	710175	710185	710195	710205	710215	710225	710235	710245	710255	710265	710275	710285	710295	710305	710315	710325	710335	710345	710355										
Bilanzielle Forderungen	710070	710075												710470					710470																									
Außerbilanzielle Forderungen und Derivate	710075	710075												710475	710175	710185	710195	710205	710475	710215	710225	710235	710245	710255	710265	710275	710285	710295	710305	710315	710325	710335	710345	710355										

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

Periodizität: Vierteljährlich

KREDITRISIKO - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ											KREDITRISIKO - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ											KREDITRISIKO - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ								
TEL A											TEL B											TEL C								
IBB Forderungsklasse																														
Ratingkategorie	Hermes Rating System			Büroberprüfung von Berücksichtigung von Umweltaspekten	Kreditkriterien/Techniken mit Substitutionsregeln						Nebelinstrumente nach Substitutionsregeln durch kreditkriterien/Techniken	Forderungswert	Kreditkriterien/Techniken/berücksichtigt in eigenen LGD-Schätzungen/erhöhte Behandlung von Doppelkauf								Behandlung von Doppelkauf	Forderungsgewichte durch technische Verfahren für Assets (LGD) in %	Forderungsgewichte durch technische Verfahren für Restrisiko in (Fager)	Risikogewichtete Forderungswert	Eigenes Risikogewicht	Zusatzinformationen				
	PD0-Basiswerte		Ausfallrisikoprüfung auf Grund von Umweltaspekten (%)		Hermes Kontrahenten-Ausfallrisiko	Sicherheiten ohne Sicherheitenleistungen		Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitenleistungen	Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditkriterien/Techniken				Verwendung eigener LGD-Schätzungen/Sicherheiten mit Sicherheitenleistung		Berücksichtigung von Sicherheiten mit Sicherheitenleistungen				Sicherheiten ohne Sicherheitenleistungen	Erwarteter Verlust						Wertpassungen und Zertifikate	Anzahl der Kontrahenten			
	Ultimate PD-Gewicht in %	Client PD-Gewicht in %				Garanten	Kreditrisikofaktoren		Abkässe (-)	Zufüsse (+)			Garanten	Kreditrisikofaktoren	Andere Formen der Besicherung mit Sicherheitenleistungen	Bekanntliche Einzelne Sicherheiten	Hypothekensicherheiten	Andere physische Sicherheiten										Forderungen		
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11 (1+6-9+10)	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27				
1. Summe Forderungen				804000	800000	800000	800700	800800	800900	801000	801100	801200	801300	801400	801500	801600	801700			802100	802200	802300	771280	802500	802600	802700				
Aufgliederung der Summenposition nach Forderungskategorien																														
Bilaterale Forderungen				804005								8012005								8023005										
Aufwärtstrendige Forderungen				804010								8012010								8023010										
Lohnverhältnisse und Geschäfte mit langer Abwicklungsdauer				804015								8012015								8023015										
Diverse				804020								8012020								8023020										
Produktübergreifende Rating-Vereinbarung				804025								8012025								8023025										
1.1 Summenposition nach Ratingkategorie				800200	804030	800800	800700	800800	800900	801000	801100	801200	801300	801400	801500	801600	801700			802100	802200	802300	802400	802500	802600	802700				
Aufgliederung der Summenposition nach Ratingkategorie																														
Ratingkategorie (a)												8011005	8012005								8021005	8022005	8023005	8024005						
2				8001020	8002020	8003020	804020								8011020	8012020								8021020	8022020	8023020	8024020			
1.2 Projektfinanzierung Setting Ansatz (b) - Summe				804040								8011040	8012040								8021040	8022040	8023040	8024040						
Aufgliederung der Summenposition "Projektfinanzierung" nach Risikogewichten																														
Risikogewicht (%)				804045															8021045	8022045	8023045	8024045								
50%				804050															8021050	8022050	8023050	8024050								
70%				804055															8021055	8022055	8023055	8024055								
90%				804060															8021060	8022060	8023060	8024060								
100%				804065															8021065	8022065	8023065	8024065								
115%				804070															8021070	8022070	8023070	8024070								
200%				804075															8021075	8022075	8023075	8024075								
1.3 Alternative Anwendung: hypothekensicher basierend				804080								8011080	8012080								8021080	8022080	8023080	8024080						
1.4 Forderungen, Verleihen rüfungswert nach der alternativen Anwendung oder mit 100%																														
1.5 Verleihenrisikofaktor: Summe der Forderungskategorie				804085																						8021085				

(a) Anordnung von der niedrigsten zur höchsten durchschnittlichen Ausfallwahrscheinlichkeit gemäß Ratingkategorie. Die Ausfallwahrscheinlichkeit im Falle eines Ausfalls beträgt 100%. Forderungskategorien nach der alternativen Anwendung von hypothekensicher Basierung ist nur erlaubt, wenn es keine eigenen LGD-Schätzungen gibt.
 (b) Diese Zellen stehen für die Forderungsklassen "Projektfinanzierung", "Unternehmer" und für die "Summe Forderungen" zur Verfügung.
 (c) Anordnung von der niedrigsten zur höchsten durchschnittlichen Ausfallwahrscheinlichkeit gemäß Ratingkategorie. Die Ausfallwahrscheinlichkeit im Falle eines Ausfalls beträgt 100%. Forderungskategorien nach der alternativen Anwendung von hypothekensicher Basierung ist nur erlaubt, wenn es keine eigenen LGD-Schätzungen gibt.
 (d) Diese Zellen stehen für die Forderungsklassen "Projektfinanzierung", "Unternehmer" und für die "Summe Forderungen" zur Verfügung.

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	Kreditsikomindernde Techniken mit Substitutionseffekten				Nettoforderung nach Substitutionseffekt durch kreditsikomindernde Techniken		Forderungswert		Forderungsgewichtete durchschnittliche Verlustquote bei Ausfall (LGD) in %	Risikogewichteter Forderungswert	Eigenmittelerfordernis	Zusatzinformationen:	
	(PD)-Bandbreite		Ausfallswahrscheinlichkeit aufgrund Bonitätsseinstufung (%)		Sicherheiten ohne Sicherheitsleistungen		Substitution von Teilen der Forderungen aufgrund von entsprechenden kreditsikomindernden Techniken		Hieron außerbilanzielle Forderungen	Hieron außerbilanzielle Forderungen	Erwarteter Verlust	Wertberichtigungen und Rückstellungen					
	Untere PD-Grenze in %	Oberer PD-Grenze in %			Garantien	Kreditderivate	Abflüsse (-)	Zuflüsse (+)									
	1	2	3		4	5	6	7	8	9	10	11				12	13
Summe IRB-Forderungskategorie Beteiligungen														8514000	7712850	8516000	8517000
1. PDLGD-Ansatz: Summe				8504005	8505005	8506005	8507005	8508005	8509005	8510005	8511005	8512005	8513005	8514005	8515005		
Aufgliederung der Summenposition gemäß PDLGD-Ansatz nach Ratingstufe																	
Ratingstufe (a): 1																	
2	<...>	8501010	8502010	8503010	8504010				8509010	8510010	8511010	8512010	8513010	8514010	8515010		
.....																	
N																	
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%				8504020					8509020	8510020	8511020	8512020		8514020	8515020		
290%				8504025					8509025	8510025	8511025	8512025		8514025	8515025		
370%				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 VEREINFACHUNG - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ																								KREDITRISIKO VEREINFACHUNG - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ																								KREDITRISIKO VEREINFACHUNG - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ																								KREDITRISIKO VEREINFACHUNG - AUF INTERNEN RATINGS BASIERENDER ANSATZ																							
TEIL A VERGLEICHSKLASSE												TEIL B												TEIL C												TEIL D																																																											
Kategorie	Systemische Verflechtung: Beschreibung der wesentlichen Forderung	Systemische Verflechtung: Beschreibung der wesentlichen Forderung				Verflechtungsbeziehung	Kreditkennzeichnende Merkmale mit Substitutionsmerkmalen				Anforderungen an die Kreditnehmer (z.B. Sicherheiten, Besondere Sicherheiten, Besondere Sicherheiten, Besondere Sicherheiten)	Anforderungen an die Kreditnehmer (z.B. Sicherheiten, Besondere Sicherheiten, Besondere Sicherheiten)				Anforderungen an die Kreditnehmer (z.B. Sicherheiten, Besondere Sicherheiten, Besondere Sicherheiten)	Anforderungen an die Kreditnehmer (z.B. Sicherheiten, Besondere Sicherheiten, Besondere Sicherheiten)												Anforderungen an die Kreditnehmer (z.B. Sicherheiten, Besondere Sicherheiten, Besondere Sicherheiten)	Anforderungen an die Kreditnehmer (z.B. Sicherheiten, Besondere Sicherheiten, Besondere Sicherheiten)	Anforderungen an die Kreditnehmer (z.B. Sicherheiten, Besondere Sicherheiten, Besondere Sicherheiten)	Anforderungen an die Kreditnehmer (z.B. Sicherheiten, Besondere Sicherheiten, Besondere Sicherheiten)	Anforderungen an die Kreditnehmer (z.B. Sicherheiten, Besondere Sicherheiten, Besondere Sicherheiten)																																																														
		1	2	3	4		5	6	7	8		9	10	11	12		13	14	15	16	17	18	19 (a) (b)	Mittlung										20	21	22	23	24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	34	35	36																																													
																								6-10%	11-15%	16-20%	21-25%	26-30%																							31-35%	36-40%	41-45%	46-50%	51-55%	56-60%	61-65%	66-70%	71-75%	76-80%																																			
Bankkredit	720010	720020	720030	720040	720050	720060	720070	720080	720090	720100	720110	720120	720130	720140	720150	720160	720170	720180	720190	720200	720210	720220	720230	720240	720250	720260	720270	720280	720290	720300	720310	720320	720330	720340	720350	720360	720370	720380	720390	720400	720410	720420	720430	720440	720450	720460	720470	720480	720490	720500																																													
Mehrfachkredit	720510	720520	720530	720540	720550	720560	720570	720580	720590	720600	720610	720620	720630	720640	720650	720660	720670	720680	720690	720700	720710	720720	720730	720740	720750	720760	720770	720780	720790	720800	720810	720820	720830	720840	720850	720860	720870	720880	720890	720900	720910	720920	720930	720940	720950	720960	720970	720980	720990	721000																																													
Wohnkredit	721010	721020	721030	721040	721050	721060	721070	721080	721090	721100	721110	721120	721130	721140	721150	721160	721170	721180	721190	721200	721210	721220	721230	721240	721250	721260	721270	721280	721290	721300	721310	721320	721330	721340	721350	721360	721370	721380	721390	721400	721410	721420	721430	721440	721450	721460	721470	721480	721490	721500																																													
Kreditlinie	721510	721520	721530	721540	721550	721560	721570	721580	721590	721600	721610	721620	721630	721640	721650	721660	721670	721680	721690	721700	721710	721720	721730	721740	721750	721760	721770	721780	721790	721800	721810	721820	721830	721840	721850	721860	721870	721880	721890	721900	721910	721920	721930	721940	721950	721960	721970	721980	721990	722000																																													

KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN DETAILS: DETAILIERTE INFORMATIONEN ZU VERBRIEFUNGEN DURCH ORIGINATOREN UND SPONSOREN														KREDITRISIKO VERBRIEFUNGEN DETAILS: DETAILIERTE INFORMATIONEN ZU VERBRIEFUNGEN DURCH ORIGINATOREN UND SPONSOREN														
TEIL A														TEIL B														
Laufende Nummer	Kennung der Verbriefung	Verbriefungstyp: (Traditionell/ Synthetisch)	Rolle des Institut: Sponsor/Originator	Nicht-ABCP (asset backed commercial paper) Programme		Verbrieft Forderungen (Originatorsseitig)								Verbriefungsstruktur	Verbriefungspositionen (Ursprüngliche Forderung vor Anwendung der Umrechnungskategorien)										Abzug von den Eigenmitteln (-)	Eigenmittel- erfordernis vor "CAP"	Eigenmittel- erfordernis nach "CAP"	
				Verbriefungsdatum (mm/jj)	Summe der verbrieften Forderungen (originatorsseitig zum Zeitpunkt des Verbriefungsdatums)	Summe	Institutenanteil (%)	Typ	Angewandeter Ansatz (SA,IRB/MKM)	Anzahl der Forderungen	ELGD (%)	Wertberichtigungen und Rückstellungen	Eigenmittelaufschlag vor Verbriefung in % der Forderungsbeträge		Bilanzielle Forderungen				Aufwandsorientierte Forderungen und Derivate			Vorsichtige Rückzahlung (early amortisation)						
															Most Senior		Mezzanine		First Loss		Direkter Kreditaufschlag	Anerkennung Liquiditätszuschüssen	Andere	Kontrolliert? (Ja/Nein)				Angewandeter 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 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
Basisindikatoransatz	9001000	9002000	9003000				7741800						
Standardansatz (SA)/ Standardansatz (ASA) Alternativer							7742800						
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				7743800	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			7731815 (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 Rating-Agentur	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			7731820 (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			7720800
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 - § 24a BWG

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 Wahrung	<_>	6800000
2. Hochststand der offenen Deisenpositionen pro Wahrung im Monat	<_>	6800001

1) Alle Wahrungen, bei denen die offene Fremdwahrungsposition 1 vH der Bilanzsumme berschreitet, sind meldepflichtig.

INTERNE MODELLE

	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	Multi- plikator
	1	2	3	4	5	6	7
Gesamtpositionen	5201000	5202000	5203000	5204000	7732800	5206000	520700 0
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			

§ 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 ¹	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 ² - 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
				Außerbilanz-mäßige 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