

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-Forderungskategorie:
Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Institutsnummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

	Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositionen	Synthetische Verbriefung: Auf das verbrieft Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechniken			Verbriefungspositionen	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten auf die IRBA-Bemessungsgrundlage				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	in Tsd Euro (-) Kreditrisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigung finanzieller Sicherheiten, Schwankungs- und lauffähiger Beträge		
		(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten; Schwankungsbereinigter Betrag (a)	(-) Abgänge insgesamt	Um Währungsinkongruenzen bereinigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Nominalbetrag zurückgehaltener oder zurückgehaltener Kreditversicherung	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 S.4 VV)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate; Inkongruenzbereinigte Beträge	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche; Inkongruenzbereinigte Beträge			Substitutionseffekte durch Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken auf die IRBA-Bemessungsgrundlage	
												(-) Abgänge insgesamt	Zulüsse insgesamt
	01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11		
010 Gesamtsumme													
011 darunter: Wiederverbriefungspositionen													
020 Originator: Gesamtengagement													
030 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen													
031 A													
032 B													
033 C													
034 D													
035 E													
070 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen													
071 A													
072 B													
073 C													
074 D													
075 E													
080 Vorzeitige Tilgung													

(a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-
Forderungsklasse:
Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Institutsnummer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

In Tsd Euro

	Gesamtbeitrag der erzeugten Verbriefungspositionen	Synthetische Verbriefung: Auf das verbrieft Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechniken				Verbriefungs- positionen	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten auf die IRBA-Bemessungsgrundlage				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	(-) Kreditrisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und lauffzeitberingte Beträge	
		(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsberingte Beträge (a)	(-) Abgänge insgesamt	Um Währungsinkongruenzen bereinigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate	Nominalbetrag zurückgehaltener oder zurückverworfener Kreditbestände		IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 S. 4 VV)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzberingte Beträge	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzberingte Beträge	Substitutionseffekte durch Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken auf die IRBA-Bemessungsgrundlage			
										(-) Abgänge insgesamt			Zulüsse insgesamt
	01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11		
090 Investor: Gesamtengagement													
091 darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWVG ist													
100 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen													
101 A													
102 B													
103 C													
104 D													
105 E													
140 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen													
141 A													
142 B													
143 C													
144 D													
145 E													
150 Sponsor: Gesamtengagement													
160 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen													
170 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen													

(a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-
Forderungsklasse:
Verbriefungsart:

Verbriefungen	Institutsnummer:	
Summenblatt	Ort:	

Prüf- ziffer:	Name:	
Stand Ende:		

		in Tsd Euro																						
	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikoindektoren	Aufgliederung der IRBA-Bemessungsgrundlage aus Spalte (12) von außerbilanziellen Positionen nach IRBA-Konversionsfaktoren				IRBA-Positionswert (§ 252 SotV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugs- positionen (-) Abzug vom Eigenkapital (§ 268 SotV)	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten																
		0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%			Ratingbasierter Ansatz (Bonitätsstufe 1 bis 11 bei Langfristrating)																
								7 - 10%	12 - 13%	20 - 35%	40 - 75%	100%	150%	200%	225%	250%	300%	350%	425%	500%	650%	750%	850%	
	12	13	14	15	16	17	18	19=17+ 18	20	21	22	23	24	42	43	44	25	45	46	47	27	48	49	
010	Gesamtsumme																							
011	darunter: Wiederverbriefungs- positionen																							
020	Originator: Gesamtengagement																							
030	Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																							
031	A																							
032	B																							
033	C																							
034	D																							
035	E																							
070	Außerbilanzielle und derivative Adressen- ausfallrisikopositionen																							
071	A																							
072	B																							
073	C																							
074	D																							
075	E																							
080	Vorzeitige Tilgung																							

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-
Forderungsklasse:
Verbriefungsart:

Verbriefungen	Institutsnummer:	
Summenblatt	Ort:	

Prüf- ziffer:	Name:	
Stand Ende:		

in Tsd Euro

	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikomodifizierungsrechnen	Aufgliederung der IRBA-Bemessungsgrundlage aus Spalte (12) von außerbilanziellen Positionen nach IRBA-Konversionsfaktoren				IRBA-Positionswert (§ 252 SotV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 268 SotV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugspositionen 19=17+18	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten														
		0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%				Ratingbasierter Ansatz (Bonitätsstufe 1 bis 11 bei Langfristating)														
									7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	150%	200%	225%	250%	300%	350%	425%	500%	650%	750%
12	13	14	15	16	17	18	19=17+18	20	21	22	23	24	42	43	44	25	45	46	26	47	27	48	49
090	Investor: Gesamtengagement																						
091	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																						
100	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																						
101	A																						
102	B																						
103	C																						
104	D																						
105	E																						
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																						
141	A																						
142	B																						
143	C																						
144	D																						
145	E																						
150	Sponsor: Gesamtengagement																						
160	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																						
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																						

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-Forderungskategorie:
Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Institutsnummer:

Ort:

Prüfziffer:

Stand Ende:

Name:

in Tsd Euro

	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten								(*) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 S.1 V)	Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 S.1 V) bei Verstoß gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)	Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufenunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kapapungsregelungen	Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	nachrichtlich: Aggregierte Kapitalanforderungen
	1250%		Bankaufsichtlicher Formelansatz		Internes Einstufungsverfahren		Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)							
	Mit Rating	Ohne Rating	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)									
010 Gesamtsumme															Übertrag ÜB-Meldebogen
011 darunter: Wiederverbriefungspositionen															Übertrag ÜB-Meldebogen
020 Originator: Gesamtengagement															
030 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen															
031 A															
032 B															
033 C															
034 D															
035 E															
070 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen															
071 A															
072 B															
073 C															
074 D															
075 E															
080 Vorzeitige Tilgung															

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-
Forderungsklasse:
Verbriefungsart:

Verbriefungen	Institutsnummer:	Prüfziffer:
Summenblatt	Ort:	Stand Ende:

Name:

		Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten							in Tsd Euro						
		1250%		Bankaufsichtlicher Formel Ansatz		Internes Einstufungsverfahren		(*) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 S.4 V)	Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 S.4 V) bei Verlust, gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und § 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)	Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitendeckung bei synthetischen Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Aggregierte Kapitalanforderungen	
Mit Rating	Ohne Rating	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschau	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)									
		28	29	30	31	32	33	34	35	36	40	41	37	38	39
090	Investor: Gesamteingagement														
091	darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist														
100	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen														
101	A														
102	B														
103	C														
104	D														
105	E														
140	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen														
141	A														
142	B														
143	C														
144	D														
145	E														
150	Sponsor: Gesamteingagement														
160	Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen														
170	Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen														