

**ERLÄUTERUNGEN ZU DEN MELDEBÖGEN ZUR LIQUIDITÄT IN
ANHANG XXIV**

TEIL 1: LIQUIDE AKTIVA

1. Liquide Aktiva

1.1. Allgemeine Bemerkungen

1. Dies ist ein zusammenfassender Meldebogen mit Angaben zu den Aktiva zwecks Meldungen im Rahmen der Liquiditätsdeckungsanforderung gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 der Kommission¹. Posten, zu denen die Kreditinstitute keine Angaben machen müssen, sind grau hinterlegt.
2. Die gemeldeten Aktiva erfüllen die Anforderungen gemäß Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.
3. Abweichend von Absatz 2 wenden die Kreditinstitute die Währungsbeschränkungen gemäß Artikel 8 Absatz 6, Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe d und Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 der Kommission nicht an, wenn der Meldebogen gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 in einer gesonderten Währung ausgefüllt wird. Die Kreditinstitute halten sich allerdings an die Beschränkungen bezüglich der Rechtsordnung.
4. Die Kreditinstitute füllen den Meldebogen in den entsprechenden Währungen gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) 575/2013 aus.
5. Gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 melden die Kreditinstitute gegebenenfalls den Betrag/Marktwert der liquiden Aktiva unter Berücksichtigung der Netto-Liquiditätsabflüsse und -zuflüsse, die sich aus einer vorzeitigen Glattstellung der Sicherungsgeschäfte im Sinne von Artikel 8 Absatz 5 Buchstabe b ergeben würden, sowie nach Maßgabe der in Kapitel 2 dieser delegierten Verordnung festgelegten Abschläge (sogenannte „Haircuts“).
6. In der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 wird nur auf Raten und Abschläge verwiesen. In diesen Erläuterungen wird der Begriff „gewichtet“ als allgemeiner Begriff verwendet, um den Betrag anzugeben, der nach Anwendung der betreffenden Abschläge, Raten und anderen relevanten zusätzlichen Erläuterungen ermittelt wurde (z. B. im Falle von besicherter Kreditvergabe und Finanzierung). Der Begriff „Gewichtung“ bezieht sich im Kontext dieser Erläuterungen auf eine Zahl zwischen 0 und 1, die multipliziert mit dem Betrag den gewichteten Betrag bzw. den Wert gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ergibt.
7. Die Kreditinstitute dürfen Posten innerhalb der Abschnitte 1.1.1., 1.1.2., 1.2.1. und 1.2.2. des Meldebogens und abschnittübergreifend nicht doppelt melden.

¹ Delegierte Verordnung (EU) 2015/61 der Kommission vom 10. Oktober 2014 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates in Bezug auf die Liquiditätsdeckungsanforderung an Kreditinstitute (ABl. L 11 vom 17.1.2015, S. 1).

1.2. __Besondere Bemerkungen

1.2.1. __Spezifische Anforderungen in Bezug auf OGA

8. Für die Posten 1.1.1.10., 1.1.1.11., 1.2.1.6., 1.1.2.2., 1.2.2.10., 1.2.2.11., 1.2.2.12. und 1.2.2.13. des Meldebogens melden die Kreditinstitute den jeweiligen Anteil des Marktwerts der OGA entsprechend den dem Organismus zugrunde liegenden liquiden Aktiva gemäß Artikel 15 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.

1.2.2. __Spezifische Anforderungen in Bezug auf Bestandsschutz und Übergangsbestimmungen

9. Die Kreditinstitute melden die Posten gemäß den Artikeln 35 bis 37 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 in den entsprechenden Zeilen für Aktiva. Die Summe aller Aktivabeträge, die auf der Grundlage dieser Artikel gemeldet werden, wird zu Referenzzwecken auch im Abschnitt „Zusatzinformationen“ ausgewiesen.

1.2.3. __Spezifische Anforderungen in Bezug auf Meldungen durch Zentralinstitute

10. Zentralinstitute stellen bei der Meldung liquider Aktiva, die Einlagen von Kreditinstituten beim Zentralinstitut entsprechen und als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden, sicher, dass der gemeldete Betrag dieser liquiden Aktiva nach Abschlag den Abfluss aus den entsprechenden Einlagen gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 nicht übersteigt.

1.2.4. __Spezifische Anforderungen in Bezug auf Abwicklung und Forward-Geschäfte

11. Alle Aktiva gemäß Artikel 7, 8 und 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, die sich zum Stichtag im Bestand des Kreditinstituts befinden, werden in der entsprechenden Zeile des Meldebogens C 72 gemeldet, selbst wenn sie verkauft oder in gesicherten Forward-Geschäften verwendet werden. Entsprechend werden liquide Aktiva aus Forward-Geschäften, die sich auf vertraglich vereinbarte, aber noch nicht abgewickelte Käufe liquider Aktiva und Terminkäufe liquider Aktiva beziehen, in diesem Meldebogen nicht gemeldet.

1.2.5. __Einzelbogen liquide Aktiva

1.2.5.1 Erläuterungen zu bestimmten Spalten

| Spalte | Rechtsgrundlagen und Erläuterungen |
|--------|---|
| 0010 | <p>Betrag/Marktwert</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0010 den Marktwert oder gegebenenfalls den Betrag der liquiden Aktiva gemäß Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Der in Spalte 0010 gemeldete Betrag/Marktwert:</p> <ul style="list-style-type: none">— berücksichtigt die Nettoabflüsse und -zuflüsse aufgrund einer vorzeitigen Glattstellung der Sicherungsgeschäfte gemäß Artikel 8 Absatz 5 der genannten Verordnung;— berücksichtigt keine Abschläge nach Maßgabe des Titels II der genannten Verordnung; |

| | |
|------|---|
| | <p>— beinhaltet den Anteil der Einlagen im Sinne des Artikels 16 Absatz 1 Buchstabe a der genannten Verordnung in Form von verschiedenen spezifischen Aktiva in den entsprechenden Zeilen für Aktiva;</p> <p>— wird gegebenenfalls um den Betrag der in Artikel 16 definierten Einlagen bei dem zentralen Kreditinstitut gemäß Artikel 27 Absatz 3 der genannten Verordnung verringert.</p> <p>Bei der Bezugnahme auf Artikel 8 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 berücksichtigen die Kreditinstitute den Netto-Cashflow, entweder Ab- oder Zufluss, der sich im Falle der Glattstellung der Sicherungsgeschäfte zum Meldestichtag ergeben würde. Dabei werden potenzielle künftige Wertänderungen bei den Aktiva von den Kreditinstituten nicht berücksichtigt.</p> |
| 0020 | <p>Standardgewichtung</p> <p>Spalte 0020 enthält die Gewichtung entsprechend dem errechneten Betrag nach Anwendung der jeweiligen Abschläge gemäß Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. Die Gewichtung soll die Wertminderung der liquiden Aktiva nach Anwendung der jeweiligen Abschläge widerspiegeln.</p> |
| 0030 | <p>Anwendbare Gewichtung</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0030 die anwendbare Gewichtung für liquide Aktiva gemäß Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. Anwendbare Gewichtungen können zu gewichteten Durchschnittswerten führen und werden im Dezimalformat gemeldet (z. B. 1,00 für eine anwendbare Gewichtung von 100 Prozent oder 0,50 für eine anwendbare Gewichtung von 50 Prozent). Anwendbare Gewichtungen können u. a. unternehmensspezifische und nationale Ermessensspielräume widerspiegeln. Die in Spalte 0030 gemeldete Zahl darf die Zahl in Spalte 0020 nicht überschreiten.</p> |
| 0040 | <p>Wert gemäß Artikel 9</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0040 den gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ermittelten Wert der liquiden Aktiva, der dem Wert/Marktwert unter Berücksichtigung der Netto-Liquiditätsabflüsse und -zuflüsse aufgrund einer vorzeitigen Glattstellung der Sicherungsgeschäfte, multipliziert mit der anwendbaren Gewichtung, entspricht.</p> |

1.2.5.2 Erläuterungen zu bestimmten Zeilen

| Zeile | Rechtsgrundlagen und Erläuterungen |
|-------|--|
| 0010 | <p>1. SUMME DER UNBEREINIGTEN LIQUIDEN AKTIVA</p> <p>Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0010 den Gesamtbetrag/Marktwert ihrer liquiden Aktiva.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0040 den gemäß Artikel 9 berechneten Gesamtwert ihrer liquiden Aktiva.</p> |

| | |
|------|---|
| 0020 | <p>1.1. Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 1</p> <p>Artikel 10, 15, 16 und 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die in diesem Abschnitt gemeldeten Aktiva wurden explizit als Aktiva der Stufe 1 gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ermittelt oder behandelt.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0010 den Gesamtbetrag/Marktwert ihrer liquiden Aktiva der Stufe 1.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0040 den gemäß Artikel 9 berechneten Gesamtwert ihrer liquiden Aktiva der Stufe 1.</p> |
| 0030 | <p>1.1.1. Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Artikel 10, 15, 16 und 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die in diesem Unterabschnitt gemeldeten Aktiva wurden explizit als Aktiva der Stufe 1 gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ermittelt oder behandelt. Aktiva und zugrunde liegende Aktiva, die als gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität im Sinne von Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe f der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gelten, werden in diesem Unterabschnitt nicht gemeldet.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0010 die Summe der Gesamtmarktwerte der Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, ohne den Anforderungen des Artikels 17 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Rechnung zu tragen.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0040 die Summe der gewichteten Gesamtbeträge der Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, ohne den Anforderungen des Artikels 17 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Rechnung zu tragen.</p> |
| 0040 | <p>1.1.1.1. Münzen und Banknoten</p> <p>Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Gesamtwert des Bargeldbestands.</p> |
| 0050 | <p>1.1.1.2. Abziehbare Zentralbankreserven</p> <p>Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe b Ziffer iii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Gesamtbetrag der Reserven, die in Stressphasen jederzeit abgezogen werden können und von dem Kreditinstitut bei der EZB, der Zentralbank eines Mitgliedstaats oder der Zentralbank eines Drittlands gehalten werden, sofern eine benannte externe Ratingagentur (ECAI) Risikopositionen gegenüber der betreffenden Zentralbank oder deren Zentralstaat eine Bonitätsbeurteilung zuweist, die mindestens der Bonitätsstufe 1 gemäß Artikel 114 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 entspricht.</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Der entsprechende abziehbare Betrag wird in einer Vereinbarung zwischen der für das Kreditinstitut zuständigen Behörde und der Zentralbank, bei der die Reserven gehalten werden, oder in den anwendbaren Vorschriften des Drittlands im Sinne von Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe b Ziffer iii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 festgelegt.</p> |
| 0060 | <p>1.1.1.3. Zentralbank-Aktiva</p> <p>Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe b Ziffern i und ii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Aktiva in Form von Forderungen, die gegenüber der Europäischen Zentralbank (EZB), der Zentralbank eines Mitgliedstaats oder der Zentralbank eines Drittlands bestehen oder von diesen garantiert werden, sofern eine benannte externe Ratingagentur (ECAI) Risikopositionen gegenüber der betreffenden Zentralbank oder deren Zentralstaat eine Bonitätsbeurteilung zuweist, die mindestens der Bonitätsstufe 1 gemäß Artikel 114 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 entspricht.</p> |
| 0070 | <p>1.1.1.4. Zentralstaat-Aktiva</p> <p>Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe c Ziffern i und ii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva in Form von Forderungen, die gegenüber dem Zentralstaat eines Mitgliedstaats oder dem Zentralstaat eines Drittlands bestehen oder von diesen garantiert werden, sofern eine benannte externe Ratingagentur (ECAI) diesen Aktiva eine Bonitätsbeurteilung zuweist, die mindestens der Bonitätsstufe 1 gemäß Artikel 114 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 entspricht.</p> <p>In dieser Zeile werden Aktiva gemäß Artikel 35 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ausgewiesen, die von Kreditinstituten begeben wurden, für die eine Garantie des Zentralstaats eines Mitgliedstaats besteht.</p> <p>In dieser Zeile werden Aktiva gemäß Artikel 36 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gemeldet, die durch von einem Mitgliedstaat geförderte Einrichtungen für die Verwaltung wertgeminderter Vermögenswerte begeben wurden.</p> |
| 0080 | <p>1.1.1.5. Aktiva von regionalen/lokalen Gebietskörperschaften</p> <p>Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe c Ziffern iii und iv der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva in Form von Forderungen, die gegenüber den regionalen oder lokalen Gebietskörperschaften eines Mitgliedstaats bestehen oder von diesen garantiert werden, sofern sie wie Risikopositionen gegenüber dem Zentralstaat des Mitgliedstaats gemäß Artikel 115 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 behandelt werden.</p> <p><u>Aktiva</u> in Form von Forderungen, die gegenüber den regionalen oder lokalen Gebietskörperschaften eines Drittlands bestehen oder von diesen garantiert werden, sofern eine benannte externe Ratingagentur (ECAI)</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>eine Bonitätsbeurteilung zuweist, die mindestens der Bonitätsstufe 1 gemäß Artikel 114 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 entspricht, und sofern sie wie Risikopositionen gegenüber dem Zentralstaat des Drittlands gemäß Artikel 115 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 behandelt werden.</p> <p>In dieser Zeile werden Aktiva gemäß Artikel 35 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ausgewiesen, die von Kreditinstituten begeben wurden, für die eine Garantie einer regionalen oder lokalen Gebietskörperschaft eines Mitgliedstaats besteht.</p> |
| 0090 | <p>1.1.1.6. Aktiva von öffentlichen Stellen</p> <p>Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe c Ziffern v und vi der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva in Form von Forderungen, die gegenüber den öffentlichen Stellen eines Mitgliedstaats oder eines Drittlands bestehen oder von diesen garantiert werden, sofern diese Aktiva gemäß Artikel 116 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 wie Risikopositionen gegenüber dem Zentralstaat oder den regionalen oder lokalen Gebietskörperschaften dieses Mitgliedstaats oder Drittlands behandelt werden.</p> <p>Risikopositionen gegenüber dem Zentralstaat eines in einem vorstehenden Absatz genannten Drittlands wird eine Bonitätsbeurteilung einer externen Ratingagentur (ECAI) zugewiesen, die mindestens der Bonitätsstufe 1 nach Artikel 114 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 entspricht.</p> <p>Risikopositionen gegenüber einer regionalen oder lokalen Gebietskörperschaft eines in diesem Unterabschnitt genannten Drittlands werden gemäß Artikel 115 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 wie Risikopositionen gegenüber dem Zentralstaat des Drittlands behandelt.</p> |
| 0100 | <p>1.1.1.7. Ansetzbare Zentralstaat- oder Zentralbank-Aktiva in Landes- oder Fremdwährung</p> <p>Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva in Form von Forderungen, die gegenüber dem Zentralstaat oder der Zentralbank eines Drittlands bestehen, dem keine Bonitätsbeurteilung der Bonitätsstufe 1 durch eine benannte ECAI zugewiesen ist, oder von diesen garantiert werden, sowie Reserven bei einer derartigen Zentralbank unter den Bedingungen des Artikels 10 Absatz 1 Buchstabe d Ziffer ii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, sofern das Kreditinstitut diese Aktiva insgesamt als Aktiva der Stufe 1 bis zu dem Betrag ansetzt, der seinen Netto-Liquiditätsabflüssen unter Stressbedingungen in derselben Währung entspricht.</p> <p>Aktiva in Form von Forderungen, die gegenüber dem Zentralstaat oder der Zentralbank eines Drittlands, dem keine Bonitätsbeurteilung der Bonitätsstufe 1 durch eine benannte ECAI zugewiesen ist, bestehen oder von diesen garantiert werden, sowie Reserven bei einer derartigen</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Zentralbank unter den Bedingungen des Artikels 10 Absatz 1 Buchstabe d Ziffer ii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, wobei diese Aktiva nicht auf die Landeswährung dieses Drittlands lauten, sofern das Kreditinstitut diese Aktiva bis zu dem Betrag als Aktiva der Stufe 1 ansetzt, den seine Netto-Liquiditätsabflüsse unter Stressbedingungen in dieser Fremdwährung erreichen, die seiner Tätigkeit in dem Land, in dem das Liquiditätsrisiko übernommen wird, entspricht.</p> |
| 0110 | <p>1.1.1.8. Aktiva von Kreditinstituten (von Instituten, die durch einen Mitgliedstaat geschützt sind bzw. Förderdarlehen ausreichen)</p> <p>Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe e Ziffern i und ii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva, die von Kreditinstituten begeben wurden, die ihren Sitz in einem Mitgliedstaat haben oder vom Zentralstaat oder einer regionalen oder lokalen Gebietskörperschaft eines Mitgliedstaats gegründet wurden, die rechtlich verpflichtet sind, die wirtschaftliche Grundlage des Kreditinstituts zeit seines Bestehens zu schützen und sein finanzielles Überleben zu sichern.</p> <p>Aktiva, die von einem Förderdarlehen ausreichenden Institut im Sinne von Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe e Ziffer ii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 begeben wurden.</p> <p>Risikopositionen gegenüber einer vorgenannten regionalen oder lokalen Gebietskörperschaft werden wie Risikopositionen gegenüber dem Zentralstaat des Mitgliedstaats gemäß Artikel 115 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 behandelt.</p> |
| 0120 | <p>1.1.1.9. Aktiva von multilateralen Entwicklungsbanken und internationalen Organisationen</p> <p>Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe g der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva in Form von Forderungen, die gegenüber den in Artikel 117 Absatz 2 bzw. Artikel 118 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten multilateralen Entwicklungsbanken und internationalen Organisationen bestehen oder von diesen garantiert werden.</p> |
| 0130 | <p>1.1.1.10. Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit Münzen/Banknoten und/oder Risikopositionen der Zentralbank als zugrunde liegenden Aktiva</p> <p>Artikel 15 Absatz 2 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktien oder Anteile von OGA, denen Münzen, Banknoten und Risikopositionen gegenüber der EZB oder der Zentralbank eines Mitgliedstaats oder Drittlands als Aktiva zugrunde liegen, sofern eine benannte externe Ratingagentur (ECAI) Risikopositionen gegenüber der Zentralbank des Drittlands oder dem Zentralstaat des Drittlands eine Bonitätsbeurteilung zuweist, die mindestens der Bonitätsstufe 1 <u>gemäß</u> Artikel 114 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 entspricht.</p> |

| | |
|------|---|
| 0140 | <p>1.1.1.11. Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, als zugrunde liegenden Aktiva</p> <p>Artikel 15 Absatz 2 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktien oder Anteile von OGA, denen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen Münzen, Banknoten, Risikopositionen gegenüber der EZB und der Zentralbank eines Mitgliedstaats oder eines Drittlands und gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität im Sinne von Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe f der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, als Aktiva zugrunde liegen.</p> |
| 0150 | <p>1.1.1.12. Alternative Liquiditätsansätze: Kreditfazilität der Zentralbank</p> <p>Artikel 19 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Nicht in Anspruch genommener Betrag von Kreditfazilitäten der EZB und der Zentralbank eines Mitgliedstaats oder eines Drittlands, sofern die Fazilität die Anforderungen des Artikels 19 Absatz 1 Buchstabe b Ziffern i bis iii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0160 | <p>1.1.1.13. Zentralinstitute: Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, die als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden</p> <p>Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 müssen liquide Aktiva, die Einlagen von Kreditinstituten beim Zentralinstitut entsprechen und als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden, ermittelt werden. Diese liquiden Aktiva zählen nicht für die Deckung anderer Abflüsse als denjenigen aus den entsprechenden Einlagen und werden bei der Berechnung der Zusammensetzung des verbleibenden Liquiditätspuffers gemäß Artikel 17 für das Zentralinstitut auf Ebene des einzelnen Instituts nicht berücksichtigt.</p> <p>Zentralinstitute müssen bei der Meldung dieser Aktiva sicherstellen, dass der gemeldete Betrag dieser liquiden Aktiva nach Abschlag den Abfluss aus den entsprechenden Einlagen nicht übersteigt.</p> <p>Bei den in dieser Zeile genannten Aktiva handelt es sich um Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität.</p> |
| 0170 | <p>1.1.1.14. Alternative Liquiditätsansätze: Aktiva der Stufe 2A, die als Stufe 1 anerkannt werden</p> <p>Artikel 19 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Wenn ein Defizit an Aktiva der Stufe 1 besteht, melden die Kreditinstitute gemäß Artikel 19 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 den Betrag der Aktiva der Stufe 2A, die als</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Stufe 1 anerkannt und nicht als Stufe 2A gemeldet werden. Diese Aktiva werden nicht im Abschnitt für Aktiva der Stufe 2A ausgewiesen.</p> |
| 0180 | <p>1.1.2. Summe der unbereinigten gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1</p> <p>Artikel 10, 15 und 16 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die in diesem Unterabschnitt gemeldeten Aktiva wurden gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 explizit als Aktiva der Stufe 1 ermittelt oder behandelt und sind oder die ihnen zugrunde liegenden Vermögenswerte gelten als gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität im Sinne des Artikels 10 Absatz 1 Buchstabe f der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0010 die Summe der Gesamtmarktwerte der gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1, ohne den Anforderungen des Artikels 17 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Rechnung zu tragen.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0040 die Summe der gewichteten Gesamtbeträge der gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1, ohne den Anforderungen des Artikels 17 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Rechnung zu tragen.</p> |
| 0190 | <p>1.1.2.1. Gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe f der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva in Form von Risikopositionen in Form gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität gemäß Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe f der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0200 | <p>1.1.2.2. Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität als zugrunde liegenden Aktiva</p> <p>Artikel 15 Absatz 2 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA, denen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität gemäß Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe f der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als Aktiva zugrunde liegen.</p> |
| 0210 | <p>1.1.2.3. Zentralinstitute: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1, die als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden</p> <p>Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 müssen liquide Aktiva, die Einlagen von Kreditinstituten beim Zentralinstitut entsprechen und als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden, ermittelt werden. Diese liquiden Aktiva zählen nicht für die Deckung anderer Abflüsse als denjenigen aus den entsprechenden Einlagen und werden bei der Berechnung der</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Zusammensetzung des verbleibenden Liquiditätspuffers gemäß Artikel 17 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 für das Zentralinstitut auf Ebene des einzelnen Instituts nicht berücksichtigt.</p> <p>Zentralinstitute müssen bei der Meldung dieser Aktiva sicherstellen, dass der gemeldete Betrag dieser liquiden Aktiva nach Abschlag den Abfluss aus den entsprechenden Einlagen nicht übersteigt.</p> <p>Bei den in dieser Zeile genannten Aktiva handelt es sich um gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1.</p> |
| 0220 | <p>1.2. Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 2</p> <p>Artikel 11, 16 und 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die in diesem Abschnitt gemeldeten Aktiva wurden explizit als Aktiva der Stufe 2A oder 2B gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ermittelt oder in ähnlicher Weise behandelt.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0010 den Gesamtbetrag/Marktwert ihrer liquiden Aktiva der Stufe 2.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0040 den gemäß Artikel 9 berechneten Gesamtwert ihrer liquiden Aktiva der Stufe 2.</p> |
| 0230 | <p>1.2.1. Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Artikel 11, 15 und 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die in diesem Unterabschnitt gemeldeten Aktiva wurden explizit als Aktiva der Stufe 2A gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ermittelt oder behandelt.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0010 die Summe der Gesamtmarktwerte der Aktiva der Stufe 2A, ohne den Anforderungen des Artikels 17 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Rechnung zu tragen.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0040 die Summe der gewichteten Gesamtbeträge der Aktiva der Stufe 2A, ohne den Anforderungen des Artikels 17 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Rechnung zu tragen.</p> |
| 0240 | <p>1.2.1.1. Aktiva von regionalen/lokalen Gebietskörperschaften oder öffentlichen Stellen (Mitgliedstaat, Risikogewicht 20 %)</p> <p>Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva in Form von Forderungen, die gegenüber regionalen oder lokalen Gebietskörperschaften oder öffentlichen Stellen in einem Mitgliedstaat bestehen oder von diesen garantiert werden, soweit diesen Risikopositionen ein Risikogewicht von 20 % zugewiesen wird.</p> |
| 0250 | <p>1.2.1.2. Aktiva von Zentralbanken, Zentralstaaten, regionalen oder kommunalen Gebietskörperschaft oder öffentlichen Stellen (Drittland, Risikogewicht 20 %)</p> <p>Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Aktiva in Form von Forderungen, die gegenüber dem Zentralstaat oder der Zentralbank eines Drittlands oder einer regionalen oder lokalen Gebietskörperschaft oder öffentlichen Stelle in einem Drittland bestehen oder von diesen garantiert werden, sofern diesen Aktiva ein Risikogewicht von 20 % zugewiesen wird.</p> |
| 0260 | <p>1.2.1.3. Gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität (Bonitätsstufe 2)</p> <p>Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva in Form von Risikopositionen in der Gestalt von gedeckten Schuldverschreibungen hoher Qualität, die den Anforderungen des Artikels 11 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 entsprechen, sofern diesen Aktiva eine Bonitätsbeurteilung einer benannten externen Ratingagentur (ECAI) zugewiesen wird, die mindestens der Bonitätsstufe 2 nach Artikel 129 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 entspricht.</p> |
| 0270 | <p>1.2.1.4. Gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität (Drittland, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva in Form von Risikopositionen in der Gestalt von gedeckten Schuldverschreibungen, die von Kreditinstituten in Drittländern begeben wurden und den Anforderungen des Artikels 11 Absatz 1 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 entsprechen, sofern diesen Aktiva eine Bonitätsbeurteilung einer benannten externen Ratingagentur (ECAI) zugewiesen wird, die der Bonitätsstufe 1 nach Artikel 129 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 entspricht.</p> |
| 0280 | <p>1.2.1.5. Unternehmensschuldverschreibungen (Bonitätsstufe 1)</p> <p>Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe e der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Unternehmensschuldverschreibungen gemäß Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe e der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0290 | <p>1.2.1.6. Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit Aktiva der Stufe 2A als zugrunde liegenden Aktiva</p> <p>Artikel 15 Absatz 2 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Anteile oder Aktien von OGA, denen Aktiva der Stufe 2A gemäß Artikel 11 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als Aktiva zugrunde liegen.</p> |
| 0300 | <p>1.2.1.7. Zentralinstitute: Aktiva der Stufe 2A, die als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden</p> <p>Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 müssen liquide Aktiva, die Einlagen von Kreditinstituten beim</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Zentralinstitut entsprechen und als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden, ermittelt werden. Diese liquiden Aktiva zählen nicht für die Deckung anderer Abflüsse als denjenigen aus den entsprechenden Einlagen und werden bei der Berechnung der Zusammensetzung des verbleibenden Liquiditätspuffers gemäß Artikel 17 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 für das Zentralinstitut auf Ebene des einzelnen Instituts nicht berücksichtigt.</p> <p>Zentralinstitute müssen bei der Meldung dieser Aktiva sicherstellen, dass der gemeldete Betrag dieser liquiden Aktiva nach Abschlag den Abfluss aus den entsprechenden Einlagen nicht übersteigt.</p> <p>Bei den in dieser Zeile genannten Aktiva handelt es sich um Aktiva der Stufe 2A.</p> |
| 0310 | <p>1.2.2. Summe der unbereinigten Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Artikel 12 bis 16 und Artikel 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die in diesem Unterabschnitt gemeldeten Aktiva wurden explizit als Aktiva der Stufe 2B gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ermittelt.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0010 die Summe der Gesamtmarktwerte der Aktiva der Stufe 2B, ohne den Anforderungen des Artikels 17 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Rechnung zu tragen.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0040 die Summe der gewichteten Gesamtbeträge der Aktiva der Stufe 2B, ohne den Anforderungen des Artikels 17 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Rechnung zu tragen.</p> |
| 0320 | <p>1.2.2.1. Forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern i und ii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Risikopositionen in Form forderungsbesicherter Wertpapiere, die die Anforderungen des Artikels 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, sofern sie durch mit einer vorrangigen Hypothek besicherte Darlehen für Wohnimmobilien oder in vollem Umfang garantierte Darlehen für Wohnimmobilien gemäß Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern i und ii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 besichert sind.</p> <p>In dieser Zeile werden Aktiva gemeldet, die der Übergangsbestimmung gemäß Artikel 37 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen.</p> |
| 0330 | <p>1.2.2.2. Forderungsbesicherte Wertpapiere (Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffer iv der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Risikopositionen in Form forderungsbesicherter Wertpapiere, die die Anforderungen des Artikels 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, sofern sie durch Kfz-Darlehen und -Leasings gemäß Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffer iv der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 besichert sind.</p> |
| 0340 | <p>1.2.2.3. Gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität (Risikogewicht 35 %)</p> <p>Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe e der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktiva in Form von Risikopositionen in Form gedeckter Schuldverschreibungen, die von Kreditinstituten begeben wurden und Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe e der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 entsprechen, sofern der Pool zugrunde liegender Aktiva ausschließlich Risikopositionen umfasst, denen gemäß Artikel 125 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 bezüglich des Kreditrisikos ein Risikogewicht von höchstens 35 % zugewiesen wird.</p> |
| 0350 | <p>1.2.2.4. Forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern iii und v der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Risikopositionen in Form forderungsbesicherter Wertpapiere, die die Anforderungen des Artikels 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, sofern sie durch die in Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern iii und v der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannten Aktiva besichert sind. Es ist zu beachten, dass im Sinne des Artikels 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffer iii mindestens 80 % der Darlehensnehmer im Pool zum Zeitpunkt der Emission der Verbriefung kleine und mittlere Unternehmen sein müssen.</p> |
| 0360 | <p>1.2.2.5. Unternehmensschuldverschreibungen (Bonitätsstufen 2/3)</p> <p>Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Unternehmensschuldverschreibungen gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> |
| 0370 | <p>1.2.2.6. Unternehmensschuldverschreibungen — nicht zinsbringende Aktiva (von Kreditinstituten aus Gründen der Glaubenslehre gehalten) (Bonitätsstufen 1/2/3)</p> <p>Artikel 12 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Eine zuständige Behörde kann Kreditinstituten, die laut ihrer Gründungsurkunde aus Gründen der Glaubenslehre keine zinsbringenden Aktiva halten dürfen, Abweichungen von Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe b Ziffern ii und iii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigen, sofern nachweislich keine ausreichende Verfügbarkeit von nicht zinsbringenden Aktiva, die den unter diesen Ziffern festgelegten Anforderungen entsprechen, gegeben ist und die</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>betreffenden nicht zinsbringenden Aktiva auf privaten Märkten ausreichend liquide sind.</p> <p>Diese Kreditinstitute melden Unternehmensschuldverschreibungen, die nicht zinsbringende Aktiva umfassen, sofern sie die Anforderungen des Artikels 12 Absatz 1 Buchstabe b Ziffer i der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen und sie eine ordnungsgemäße Ausnahmegenehmigung von ihrer zuständigen Behörde erhalten haben.</p> |
| 0380 | <p>1.2.2.7. Aktien (wichtiger Aktienindex)</p> <p>Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Aktien, die die Anforderungen gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen und auf die Währung des Herkunftsmitgliedstaats des Kreditinstituts lauten.</p> <p>Darüber hinaus melden die Kreditinstitute Aktien, die die Anforderungen gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe c erfüllen und auf eine andere Währung lauten, sofern sie nur bis zu dem Betrag zur Deckung von Netto-Liquiditätsabflüssen in dieser Währung oder in dem Land, in dem das Liquiditätsrisiko übernommen wird, als Aktiva der Stufe 2B anerkannt werden.</p> |
| 0390 | <p>1.2.2.8. Nicht zinsbringende Aktiva (von Kreditinstituten aus Gründen der Glaubenslehre gehalten) (Bonitätsstufen 3–5)</p> <p>Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe f der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Es handelt sich im Falle von Kreditinstituten, die laut ihrer Gründungsurkunde aus Gründen der Glaubenslehre keine zinsbringenden Aktiva halten dürfen, um nicht zinsbringende Aktiva in Form von Forderungen, die gegenüber Zentralbanken oder Zentralstaaten oder Zentralbanken von Drittländern oder gegenüber regionalen oder lokalen Gebietskörperschaften oder öffentlichen Stellen in einem Drittland bestehen oder von diesen garantiert werden, insofern diesen Aktiva von einer benannten externen Ratingagentur (ECA) eine Bonitätsbewertung mindestens der Bonitätsstufe 5 gemäß Artikel 114 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder bei einer kurzfristigen Bonitätsbeurteilung die gleichwertige Bonitätsstufe zugewiesen wurde.</p> |
| 0400 | <p>1.2.2.9. Eingeschränkt nutzbare zugesagte Liquiditätsfazilitäten von Zentralbanken</p> <p>Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe d und Artikel 14 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Nicht in Anspruch genommene, mit Beschränkungen zugesagte Liquiditätsfazilitäten, die durch Zentralbanken bereitgestellt wurden, sofern sie die Anforderungen des Artikels 14 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0410 | <p>1.2.2.10. Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit forderungsbesicherten Wertpapieren als zugrunde liegenden Aktiva (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Artikel 15 Absatz 2 Buchstabe e der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Anteile oder Aktien von OGA, denen Aktiva der Stufe 2B im Sinne des Artikels 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern i, ii und iv der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als Basiswerte zugrunde liegen.</p> |
| 0420 | <p>1.2.2.11. Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit gedeckten Schuldverschreibungen hoher Qualität als zugrunde liegenden Aktiva (Risikogewicht 35 %)</p> <p>Artikel 15 Absatz 2 Buchstabe f der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Anteile oder Aktien von OGA, denen Aktiva der Stufe 2B gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe e der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als Aktiva zugrunde liegen.</p> |
| 0430 | <p>1.2.2.12. Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit forderungsbesicherten Wertpapieren als zugrunde liegenden Aktiva (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Artikel 15 Absatz 2 Buchstabe g der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Anteile oder Aktien von OGA, denen Aktiva der Stufe 2B gemäß Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern iii und v der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als Aktiva zugrunde liegen. Es ist zu beachten, dass im Sinne des Artikels 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffer iii mindestens 80 % der Darlehensnehmer im Pool zum Zeitpunkt der Emission der Verbriefung kleine und mittlere Unternehmen sein müssen.</p> |
| 0440 | <p>1.2.2.13. Qualifizierte Anteile oder Aktien von OGA mit Unternehmensschuldverschreibungen (Bonitätsstufen 2/3), Aktien (wichtiger Aktienindex) oder nicht zinsbringenden Aktiva (von Kreditinstituten aus Gründen der Glaubenslehre gehalten) (Bonitätsstufen 3-5) als zugrunde liegenden Aktiva</p> <p>Artikel 15 Absatz 2 Buchstabe h der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Anteile oder Aktien von OGA, denen Unternehmensschuldverschreibungen gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, Aktien gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe c der genannten Verordnung oder nicht zinsbringende Aktiva gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe f der genannten Verordnung als Aktiva zugrunde liegen.</p> |
| 0450 | <p>1.2.2.14. Einlagen von Verbandsmitgliedern bei Zentralinstituten (keine Pflichtinvestition)</p> <p>Artikel 16 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Mindesteinlage, die das Kreditinstitut beim zentralen Kreditinstitut hält, sofern dieses einem institutsbezogenen Sicherungssystem gemäß</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| | <p>Artikel 113 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, einem Verbund, das für die in Artikel 10 der genannten Verordnung vorgesehene Ausnahme in Frage käme, oder einem gesetzlich oder vertraglich geregelten Genossenschaftsverbund in einem Mitgliedstaat angehört.</p> <p>Die Kreditinstitute stellen sicher, dass das Zentralinstitut weder gesetzlich noch vertraglich dazu verpflichtet ist, die Einlagen in Form liquider Aktiva einer bestimmten Stufe oder Kategorie zu halten.</p> |
| 0460 | <p>1.2.2.15. Liquiditätsfinanzierung für Verbundmitglieder durch das Zentralinstitut (nicht festgelegte Besicherung)</p> <p>Artikel 16 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Nicht in Anspruch genommener Betrag einer beschränkten Liquiditätsfinanzierung gemäß Artikel 16 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0470 | <p>1.2.2.16. Zentralinstitute: Aktiva der Stufe 2B, die als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden</p> <p>Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 müssen liquide Aktiva, die Einlagen von Kreditinstituten bei dem Zentralinstitut entsprechen und als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden, ermittelt werden. Diese liquiden Aktiva zählen nicht für die Deckung anderer Abflüsse als denjenigen aus den entsprechenden Einlagen und werden bei der Berechnung der Zusammensetzung des verbleibenden Liquiditätspuffers gemäß Artikel 17 für das Zentralinstitut auf Ebene des einzelnen Instituts nicht berücksichtigt.</p> <p>Zentralinstitute müssen bei der Meldung dieser Aktiva sicherstellen, dass der gemeldete Betrag dieser liquiden Aktiva nach Abschlag den Abfluss aus den entsprechenden Einlagen nicht übersteigt.</p> <p>Bei den in dieser Zeile genannten Aktiva handelt es sich um Aktiva der Stufe 2B.</p> |
| ZUSATZINFORMATIONEN | |
| 0485 | <p>2. Einlagen von Verbundmitgliedern bei Zentralinstituten (Pflichtinvestition)</p> <p>Artikel 16 Absatz 1 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Gesamtbetrag der in den obigen Abschnitten gemeldeten Aktiva gemäß den Anforderungen in Artikel 16 Absatz 1 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0580 | <p>3. Aktiva der Stufen 1/2A/2B, die aus Währungsgründen ausgeschlossen werden</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Artikel 8 Absatz 6, Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe d und Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Institute melden den Anteil der in den Artikeln 10 bis 16 genannten Aktiva der Stufen 1, 2A und 2B, die gemäß Artikel 8 Absatz 6, Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe d und Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe c nicht anerkannt werden können.</p> |
| 0590 | <p>4. Aktiva der Stufen 1/2A/2B, die aus operativen Gründen, ausgenommen Währungsgründe, ausgeschlossen werden</p> <p>Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden Aktiva, die die Anforderungen des Artikels 7 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, aber nicht die Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, sofern sie nicht schon aus Währungsgründen in Zeile 0580 gemeldet wurden.</p> |

TEIL 2. ABFLÜSSE

1. Abflüsse

1.1. Allgemeine Bemerkungen

1. Dies ist ein zusammenfassender Meldebogen, in dem Angaben zu den über die nächsten 30 Tage gemessenen Liquiditätsabflüssen zu machen sind. Zweck ist die Meldung im Rahmen der Liquiditätsdeckungsanforderung gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. Posten, zu denen die Kreditinstitute keine Angaben machen müssen, sind grau hinterlegt.
2. Die Kreditinstitute füllen den Meldebogen in den entsprechenden Währungen gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) 575/2013 aus.
3. In dem zugehörigen Meldebogen zu diesen Erläuterungen sind Zusatzinformationen enthalten. Obwohl sie für die Berechnung der Quote selbst nicht unbedingt erforderlich sind, müssen sie ausgefüllt werden. Diese Informationen liefern die notwendigen Angaben, damit die zuständigen Behörden eine angemessene Bewertung im Hinblick auf die Einhaltung der Liquiditätsanforderungen durch Kreditinstitute vornehmen können. In einigen Fällen stellen sie eine detailliertere Aufschlüsselung der in den Hauptabschnitten der Meldebögen angegebenen Posten dar, während sie in anderen Fällen die zusätzlichen Liquiditätsressourcen widerspiegeln, auf die Kreditinstitute unter Umständen zugreifen können.
4. Gemäß Artikel 22 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gilt für Liquiditätsabflüsse Folgendes:
 - i. Sie umfassen die in Artikel 22 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannten Kategorien.
 - ii. Sie werden berechnet durch Multiplikation der offenen Salden der verschiedenen Kategorien von Verbindlichkeiten und außerbilanziellen Verpflichtungen mit den Raten, zu denen sie, wie in der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 dargelegt, voraussichtlich auslaufen oder in Anspruch genommen werden.
5. In der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 wird nur auf Raten und Abschläge Bezug genommen. Durch den Begriff „Gewichtung“ wird lediglich darauf verwiesen. In diesen Erläuterungen wird der Begriff „gewichtet“ als allgemeiner Begriff verwendet, um den Betrag anzugeben, der nach Anwendung der betreffenden Abschläge, Raten und anderen relevanten zusätzlichen Erläuterungen ermittelt wurde (z. B. im Falle von besicherter Kreditvergabe und Finanzierung).
6. Abflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems (ausgenommen Abflüsse aus nicht in Anspruch genommenen Kredit- bzw. Liquiditätsfazilitäten, die durch Mitglieder einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems bereitgestellt wurden, wobei die zuständige Behörde die Anwendung einer günstigeren Abflussrate genehmigt hat, und Abflüsse aus

operativen Einlagen, die im Rahmen eines institutsbezogenen Sicherungssystems oder Genossenschaftsverbunds gehalten werden) werden in den entsprechenden Kategorien gemeldet. Diese Abflüsse werden auch gesondert als Zusatzinformationen gemeldet.

7. Die Liquiditätsabflüsse werden im Meldebogen nur einmal angegeben, außer wenn zusätzliche Abflüsse gemäß Artikel 30 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 anwendbar sind oder es sich bei dem Posten um eine Angabe unter „davon“ oder um eine Zusatzinformation handelt.
8. Bei einer gesonderten Meldung im Sinne des Artikels 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 gilt stets das Folgende:
 - Es werden nur Posten und Ab- und Zuflüsse in dieser Währung gemeldet;
 - im Falle einer Währungsinkongruenz zwischen den verschiedenen Komponenten eines Geschäfts wird nur die Komponente in dieser Währung gemeldet;
 - sofern eine Aufrechnung gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 zulässig ist, darf dies nur auf Ab- und Zuflüsse in dieser Währung angewendet werden;
 - kann ein Ab- oder Zufluss optional in mehreren Währungen auftreten, führt das Kreditinstitut eine Bewertung der Währung durch, in der ein solcher Ab- oder Zufluss wahrscheinlich auftritt, und meldet den Posten nur in dieser gesonderten Währung.
9. Die Standardgewichtungen in Spalte 0040 des Meldebogens C 73.00 in Anhang XXIV entsprechen denjenigen, die in der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 standardmäßig angegeben sind, und werden hier nur zur Information bereitgestellt.
10. Der Meldebogen enthält Informationen über besicherte Liquiditätsflüsse, die in der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als „besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen“ bezeichnet werden, zur Berechnung der LCR wie in der genannten Verordnung dargelegt. Werden diese Transaktionen gegen einen Sicherheitenpool getätigt, werden für die Meldungen in diesem Meldebogen die einzelnen verpfändeten Vermögenswerte entsprechend den in Titel II Kapitel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 festgelegten Kategorien liquider Aktiva angegeben, angefangen mit den am wenigsten liquiden Aktiva. Derweil werden bei Transaktionen mit unterschiedlichen Restlaufzeiten, die gegen einen Sicherheitenpool getätigt werden, die weniger liquiden Aktiva den Transaktionen mit den längsten Restlaufzeiten zuerst zugeordnet.
11. Für Sicherheitenswaps ist ein separater Meldebogen, C 75.01 in Anhang XXIV, vorgesehen. Sicherheitenswaps, bei denen es sich um Sicherheitentauschgeschäfte handelt, werden nicht im Meldebogen für Abflüsse, C 73.00 in Anhang XXIV, gemeldet, der nur für Geschäfte Geld gegen Sicherheiten gilt.

1.2. ___ Besondere Bemerkungen in Bezug auf Abwicklung und Forward-Geschäfte

12. Die Kreditinstitute melden Abflüsse aus Forward- und Reverse-Repo-Geschäften sowie Sicherheitenswaps, die innerhalb der 30 Tage-Frist beginnen und deren Fälligkeit außerhalb dieser 30 Tage-Frist liegt, sofern die anfängliche Komponente zu einem Abfluss führt. Im Falle eines Reverse-Repo-Geschäfts wird der an die Gegenpartei zu verleihende Betrag als Abfluss angesehen und unter Posten 1.1.8.6. abzüglich des Marktwerts des als Sicherheit zu empfangenden Vermögenswerts und nach Anwendung des zugehörigen LCR Haircut, wenn ein solcher Vermögenswert als liquides Aktivum anerkannt wird, gemeldet. Wenn der zu verleihende Betrag unter dem Marktwert des als Sicherheit zu empfangenden Vermögenswerts liegt (nach LCR Haircut), wird die Differenz als Zufluss gemeldet. Wenn die zu empfangende Sicherheit nicht als liquides Aktivum anerkannt wird, wird der Abfluss in vollem Umfang gemeldet. Im Falle eines Repo-Geschäfts, bei dem der Marktwert des als Sicherheit zu empfangenden Vermögenswerts nach Anwendung des zugehörigen LCR Haircut (wenn der Vermögenswert als liquides Aktivum anerkannt wird) größer ist als der zu empfangende Geldbetrag, wird die Differenz in der oben genannten Zeile als Abfluss gemeldet. Wenn der zu erhaltene Betrag über dem Marktwert des als Sicherheit zu verleihenden Vermögenswerts liegt (nach LCR Haircut), wird die Differenz als Zufluss gemeldet. Bei Sicherheitenswaps, bei denen der Nettoeffekt des anfänglichen Tausches liquider Aktiva (unter Berücksichtigung von LCR Haircuts) zu einem Abfluss führt, wird ein solcher Abfluss in der oben genannten Zeile gemeldet.

Forward-Repo-Geschäfte, Forward-Reverse-Repo-Geschäfte und Forward-Sicherheitenswaps, die nicht innerhalb der für die LCR maßgeblichen 30 Tage-Frist beginnen und fällig werden, wirken sich nicht auf die LCR einer Bank aus und können ignoriert werden.

13. Entscheidungsbaum für Abschnitt 1 des Meldebogens C 73.00 in Anhang XXIV. Der Entscheidungsbaum gilt unbeschadet der Meldungen der Zusatzinformationen. Der Entscheidungsbaum ist Teil der Erläuterungen zur Festlegung der Kriterien für die Bewertung der Prioritätensetzung für die einzelnen gemeldeten Posten, um einheitliche und vergleichbare Meldungen sicherzustellen. Das Abarbeiten des Entscheidungsbaums allein reicht jedoch nicht aus. Die Kreditinstitute müssen stets auch die übrigen Erläuterungen in Betracht ziehen. Zur Vereinfachung werden bei dem Entscheidungsbaum Summen und Zwischensummen ignoriert, was jedoch nicht bedeutet, dass sie nicht ebenfalls ausgewiesen werden müssen. DR verweist auf die Delegierte Verordnung (EU) 2015/61.

| Nr. | Posten | Entscheidung | Meldung |
|-----|--|--------------|---------------------|
| 1 | Forward-Geschäft | Ja | Nr. 2 |
| | | Nein | Nr. 4 |
| 2 | Forward-Geschäft, das nach dem Meldestichtag | Ja | Nicht melden |

| | | | |
|----|---|------|--|
| | abgeschlossen wurde | Nein | Nr. 3 |
| 3 | Forward-Geschäfte, die innerhalb der 30-Tage-Frist beginnen und deren Fälligkeit außerhalb dieser 30 Tage-Frist liegt, sofern die anfängliche Komponente zu einem Netto-Abfluss führt. | Ja | ID 1.1.8.6. |
| | | Nein | Nicht melden |
| 4 | Posten, der zusätzliche Abflüsse gemäß Art. 30 des DR erfordert? | Ja | Nr. 5 und anschließend Nr. 51 |
| | | Nein | Nr. 5 |
| 5 | Privatkundeneinlage gemäß Art. 411 Nr. 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013? | Ja | Nr. 6 |
| | | Nein | Nr. 12 |
| 6 | Gekündigte Einlage mit einer Restlaufzeit von weniger als 30 Kalendertagen und Fälle, in denen die Auszahlung an ein anderes Kreditinstitut vereinbart wurde? | Ja | ID 1.1.1.2. |
| | | Nein | Nr. 7 |
| 7 | Einlage gemäß Art. 25 Abs. 4 des DR? | Ja | ID 1.1.1.1. |
| | | Nein | Nr. 8 |
| 8 | Einlage gemäß Art. 25 Abs. 5 des DR? | Ja | ID 1.1.1.6. |
| | | Nein | Nr. 9 |
| 9 | Einlage gemäß Art. 25 Abs. 2 des DR? | Ja | Entsprechendem Posten von ID 1.1.1.3. zuweisen |
| | | Nein | Nr. 10 |
| 10 | Einlage gemäß Art. 24 Abs. 4 des DR? | Ja | ID 1.1.1.5. |
| | | Nein | Nr. 11 |
| 11 | Einlage gemäß Art. 24 Abs. 1 des DR? | Ja | ID 1.1.1.4. |
| | | Nein | ID 1.1.1.7. |
| 12 | Verbindlichkeit, die fällig wird, möglicherweise an den Emittenten oder an den Finanzierungsgeber ausgezahlt werden muss oder an eine Erwartung des Finanzierungsgebers geknüpft ist, nach der das Kreditinstitut die Verbindlichkeit innerhalb der nächsten 30 Kalendertage zurückzahlt? | Ja | Nr. 13 |
| | | Nein | Nr. 30 |
| 13 | Aus den eigenen Betriebskosten des Instituts erwachsende Verbindlichkeit? | Ja | ID 1.1.8.1. |
| | | Nein | Nr. 14 |
| 14 | Verbindlichkeit in Form einer Anleihe, die gemäß Art. 28 Abs. 6 des DR ausschließlich auf dem Privatkundenmarkt verkauft und auf einem Privatkundenkonto geführt wird? | Ja | Pfad für Privatkundeneinlagen folgen (d. h. Antwort „Ja“ für Nr. 5 und |

| | | | |
|----|--|------|--|
| | | | dementsprechend behandeln) |
| | | Nein | Nr. 15 |
| 15 | Verbindlichkeit in Form einer Schuldverschreibung? | Ja | ID 1.1.8.2. |
| | | Nein | Nr. 16 |
| 16 | Als Sicherheit empfangene Einlage? | Ja | Entsprechenden Posten von ID 1.1.5. zuweisen |
| | | Nein | Nr. 17 |
| 17 | Einlage, die sich aus einer Korrespondenzbankbeziehung oder aus der Erbringung von Primebroker-Dienstleistungen ergibt? | Ja | ID 1.1.4.1 |
| | | Nein | Nr. 18 |
| 18 | Operative Einlage gemäß Art. 27 des DR? | Ja | Nr. 19 |
| | | Nein | Nr. 24 |
| 19 | In einem institutsbezogenen Sicherungssystem oder Genossenschaftsverbund gehalten? | Ja | Nr. 20 |
| | | Nein | Nr. 22 |
| 20 | Als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut behandelt? | Ja | ID 1.1.2.2.2. |
| | | Nein | Nr. 21 |
| 21 | Für die Zahlungsverkehrsabrechnung (Cash Clearing) und für Dienstleistungen eines Zentralinstituts innerhalb eines Verbunds gehalten? | Ja | ID 1.1.2.4. |
| | | Nein | ID 1.1.2.2.1. |
| 22 | Für Clearing-, Verwahr-, Gelddispositions- oder andere vergleichbare Dienstleistungen im Rahmen einer etablierten Geschäftsbeziehung gehalten? | Ja | Entsprechendem Posten von ID 1.1.2.1. zuweisen |
| | | Nein | Nr. 23 |
| 23 | Im Rahmen einer etablierten Geschäftsbeziehung (Andere) mit Nichtfinanzkunden gehalten? | Ja | ID 1.1.2.3. |
| | | Nein | Nr. 24 |
| 24 | Überschüssige operative Einlagen? | Ja | Entsprechendem Posten von ID 1.1.3. zuweisen |
| | | Nein | Nr. 25 |
| 25 | Andere Einlage? | Ja | Nr. 26 |
| | | Nein | Nr. 27 |
| 26 | Einlagen von Finanzkunden? | Ja | ID 1.1.4.2. |
| | | Nein | Entsprechendem Posten von |

| | | | |
|----|---|--------------|--|
| | | | ID 1.1.4.3. zuweisen |
| 27 | Verbindlichkeit aus besicherter Kreditvergabe und Kapitalmarkttransaktion, ausgenommen Derivate und Sicherheitenswaps? | Ja | Entsprechendem Posten von ID 1.2. zuweisen |
| | | Nein | Nr. 28 |
| 28 | Verbindlichkeit aus Sicherheitenswaps? | Ja | Entsprechendem Posten von C 75.01 und ID 1.3. zuweisen, falls zutreffend |
| | | Nein | Nr. 29 |
| 29 | Verbindlichkeit aus einem Abfluss von Derivaten gemäß Art. 30 Abs. 4 des DR? | Ja | ID 1.1.5.5. |
| | | Nein | Nr. 30 |
| 30 | Sonstige Verbindlichkeiten, die in den nächsten 30 Tagen fällig werden? | Ja | IFRS 1.1.8.3 |
| | | Nein | Nr. 31 |
| 31 | Vertragliche Verpflichtungen zur Ausreichung von Finanzierung gegenüber Nichtfinanzkunden, die innerhalb der nächsten 30 Tage fällig wird und über die Zuflüsse von diesen Kunden hinausgeht? | Ja | Eine der folgenden ID: 1.1.8.4.1 bis 1.1.8.4.4 |
| | | Nein | Nr. 32 |
| 32 | Sonstige nicht oben genannte Abflüsse, die in den nächsten 30 Tagen fällig werden? | Ja | IFRS 1.1.8.6 |
| | | Nein | Nr. 33 |
| 33 | Nicht in Anspruch genommener Betrag, der aus zugesagter Kredit- und Liquiditätsfazilität gemäß Art. 31 des DR in Anspruch genommen werden kann? | Ja | Nr. 34 |
| | | Nein | Nr. 42 |
| 34 | Zugesagte Kreditfazilität? | Ja | Nr. 35 |
| | | Nein | Nr. 37 |
| 35 | In einem institutsbezogenen Sicherungssystem oder Genossenschaftsverbund als liquides Aktivum für das einlegende Institut behandelt? | Ja | ID 1.1.6.1.6. |
| | | Nein | Nr. 36 |
| 36 | Bevorzugter Behandlung in einer Gruppe oder einem institutsbezogenen Sicherungssystem unterliegend? | Ja | ID 1.1.6.1.5. |
| | | Nein | Entsprechendem verbleibenden Posten von ID 1.1.6.1. zuweisen |
| 37 | Zugesagte Liquiditätsfazilität? | Ja | Nr. 38 |
| | | Nicht zutref | Nicht zutreffend |

| | | | |
|----|--|------|--|
| | | fend | |
| 38 | In einem institutsbezogenen Sicherungssystem oder Genossenschaftsverbund als liquides Aktivum für das einlegende Institut behandelt? | Ja | ID 1.1.6.2.7. |
| | | Nein | Nr. 39 |
| 39 | Bevorzugter Behandlung in einer Gruppe oder einem institutsbezogenen Sicherungssystem unterliegend? | Ja | ID 1.1.6.2.6. |
| | | Nein | Nr. 40 |
| 40 | An Verbriefungszweckgesellschaften? | Ja | Entsprechendem Posten von ID 1.1.6.2.4. zuweisen |
| | | Nein | Nr. 41 |
| 41 | An private Beteiligungsgesellschaften? | Ja | ID 1.1.6.2.3. |
| | | Nein | Entsprechendem verbleibenden Posten von ID 1.1.6.2. zuweisen |
| 42 | Anderes Produkt oder andere Dienstleistung gemäß Art. 23 des DR? | Ja | Nr. 43 |
| | | Nein | Nicht melden |
| 43 | Außerbilanzieller Posten für die Handelsfinanzierung? | Ja | ID 1.1.7.8. |
| | | Nein | Nr. 44 |
| 44 | Nicht in Anspruch genommene Darlehen und Buchkredite an Großkunden? | Ja | ID 1.1.7.2. |
| | | Nein | Nr. 45 |
| 45 | Vereinbarte, aber noch nicht in Anspruch genommene Hypothekendarlehen | Ja | ID 1.1.7.3. |
| | | Nein | Nr. 46 |
| 46 | Geplante Abflüsse in Zusammenhang mit der Verlängerung oder der Vergabe neuer Privat- oder Großkundenkredite? | Ja | ID 1.1.7.6. |
| | | Nein | Nr. 47 |
| 47 | Kreditkarten? | Ja | ID 1.1.7.4. |
| | | Nein | Nr. 48 |
| 48 | Überziehungskredite? | Ja | ID 1.1.7.5. |
| | | Nein | Nr. 49 |
| 49 | Derivateverbindlichkeiten? | Ja | ID 1.1.7.7. |
| | | Nein | Nr. 50 |
| 50 | Andere außerbilanzielle Verpflichtung und Eventualfinanzierungsverpflichtung? | Ja | ID 1.1.7.1. |
| | | Nein | ID 1.1.7.9. |
| 51 | Schuldverschreibung, die bereits unter | Ja | Nicht melden |

| | | | |
|----|---|------|--|
| | Posten 1.1.8.2 in C 73.00 gemeldet wurde? | Nein | Nr. 52 |
| 52 | Liquiditätsanforderung für Derivate gemäß Art. 30 Abs. 4 des DR, die bereits in Frage Nr. 29 berücksichtigt wurden? | Ja | Nicht melden |
| | | Nein | Entsprechenden Posten von ID 1.1.5. zuweisen |

1.3. __Erläuterungen zu bestimmten Spalten

| Spalte | Rechtsgrundlagen und Erläuterungen |
|--------|---|
| 0010 | <p>Betrag</p> <p>1.1. Spezifische Erläuterungen zu unbesicherten Geschäften/Einlagen:</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier den offenen Saldo der verschiedenen Kategorien von Verbindlichkeiten und außerbilanziellen Verpflichtungen gemäß Artikel 22 bis 31 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Vorbehaltlich der Genehmigung durch die zuständige Behörde wird innerhalb der jeweiligen Kategorie von Abflüssen der Betrag jedes Postens, der in Spalte 0010 des Meldebogens C 73.00 in Anhang XXIV gemeldet wird, durch Subtraktion des entsprechenden Betrags des einhergehenden Zuflusses gemäß Artikel 26 saldiert.</p> <p>1.2. Spezifische Erläuterungen zu besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen:</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den offenen Saldo der Verbindlichkeiten, die die Geldseite der besicherten Transaktion darstellen, gemäß Artikel 22 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0020 | <p>Marktwert der ausgereichten Sicherheiten</p> <p>Spezifische Erläuterungen zu besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen:</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier den Marktwert der ausgereichten Sicherheiten, der als aktueller Marktwert vor Abzug des Abschlags und nach Berücksichtigung der Ab- und Zuflüsse infolge der Abwicklung der zugehörigen Sicherungsgeschäfte (gemäß Artikel 8 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61) und vorbehaltlich der folgenden Bedingungen berechnet wird:</p> <p>— Wenn ein Kreditinstitut nur einen Teil seiner Aktien, Zentralstaat- oder Bankaktiva in Fremdwährung bzw. seiner Zentralstaat- oder Bankaktiva in Landeswährung innerhalb seiner erstklassigen liquiden Aktiva ansetzen kann, wird nur der ansetzbare Teil in den Zeilen für Aktiva der Stufen 1, 2A und 2B gemeldet (gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe c Ziffer ii und Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61). Wird der</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>betreffende Vermögenswert als Sicherheit verwendet, jedoch in einer Höhe, die den innerhalb der liquiden Aktiva ansetzbaren Teil übersteigt, wird der überschüssige Betrag in dem Abschnitt für nicht liquide Aktiva gemeldet;</p> <p>— Aktiva der Stufe 2A werden in der entsprechenden Zeile für solche Aktiva gemeldet, selbst wenn der Alternative Liquiditätsansatz befolgt wird (d. h., dass Aktiva der Stufe 2A bei der Meldung von besicherten Geschäften nicht in Stufe 1 verschoben werden dürfen).</p> |
| 0030 | <p>Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9</p> <p>Spezifische Erläuterungen zu besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen:</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier den Wert der ausgereichten Sicherheiten gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. Dieser Wert wird durch Multiplikation der Spalte 0020 des Meldebogens C 73.00 in Anhang XXIV mit der anwendbaren Gewichtung bzw. dem anwendbaren Abschlag aus dem Meldebogen C 72.00 in Anhang XXIV entsprechend der Art des Vermögenswerts ermittelt. Spalte 0030 des Meldebogens C 73.00 in Anhang XXIV wird bei der Berechnung des bereinigten Betrags der liquiden Aktiva im Meldebogen C 76.00 in Anhang XXIV herangezogen.</p> |
| 0040 | <p>Standardgewichtung</p> <p>Artikel 24 bis 31a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Standardgewichtungen in Spalte 0040 entsprechen denjenigen, die in der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 standardmäßig angegeben sind, und werden hier nur zur Information bereitgestellt.</p> |
| 0050 | <p>Anwendbare Gewichtung</p> <p>Sowohl unbesichert als auch besichert:</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier die anwendbaren Gewichtungen. Diese Gewichtungen entsprechen denjenigen, die in den Artikeln 22 bis 31a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 angegeben sind. Anwendbare Gewichtungen können zu gewichteten Durchschnittswerten führen und werden im Dezimalformat gemeldet (z. B. 1,00 für eine anwendbare Gewichtung von 100 Prozent oder 0,50 für eine anwendbare Gewichtung von 50 Prozent). Anwendbare Gewichtungen können u. a. unternehmensspezifische und nationale Ermessensspielräume widerspiegeln.</p> |
| 0060 | <p>Abfluss</p> <p>Sowohl unbesichert als auch besichert:</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier die Abflüsse. Diese Abflüsse werden durch Multiplikation der Spalte 0010 des Meldebogens C 73.00 in Anhang XXIV mit der Spalte 0050 des Meldebogens C 73.00 in Anhang XXIV berechnet.</p> |

1.4.____Erläuterungen zu bestimmten Zeilen

| Zeile | Rechtsgrundlagen und Erläuterungen |
|-------|---|
| 0010 | <p>1. ABFLÜSSE</p> <p>Titel III Kapitel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier die Abflüsse gemäß Titel III Kapitel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0020 | <p>1.1. Abflüsse aus unbesicherten Geschäften/Einlagen</p> <p>Artikel 20 bis 31a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier die Abflüsse gemäß Artikel 21 bis 31a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, mit Ausnahme der gemäß Artikel 28 Absätze 3 und 4 dieser Delegierten Verordnung gemeldeten Abflüsse.</p> |
| 0030 | <p>1.1.1. Privatkundeneinlagen</p> <p>Artikel 24 und 25 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier die Privatkundeneinlagen gemäß Artikel 411 Nummer 2 der Verordnung (EU) 575/2013.</p> <p>Die Kreditinstitute melden innerhalb der entsprechenden Kategorie von Privatkundeneinlagen auch den Betrag der begebenen Anleihen und anderen Schuldverschreibungen, die ausschließlich auf dem Privatkundenmarkt verkauft und auf einem Privatkundenkonto geführt werden, im Sinne des Artikels 28 Absatz 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. Die Kreditinstitute berücksichtigen bei dieser Kategorie von Verbindlichkeiten die anwendbaren Abflussraten, die in der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 für die verschiedenen Kategorien von Privatkundeneinlagen vorgesehen sind. Dementsprechend melden die Kreditinstitute als anwendbare Gewichtung den Durchschnitt der jeweiligen anwendbaren Gewichtungen für all diese Einlagen.</p> |
| 0035 | <p>1.1.1.1. Einlagen, die bei der Berechnung der Abflüsse ausgeschlossen werden</p> <p>Artikel 25 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute die Kategorien von Privatkundeneinlagen, die bei der Berechnung der Abflüsse ausgeschlossen werden dürfen, wenn die Bedingungen des Artikels 25 Absatz 4 Buchstaben a und b erfüllt sind.</p> |
| 0040 | <p>1.1.1.2. Einlagen, bei denen die Auszahlung in den nächsten 30 Tagen vereinbart wurde</p> <p>Artikel 25 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier Einlagen mit einer Restlaufzeit von weniger als 30 Tagen, bei denen die Auszahlung vereinbart wurde.</p> |
| 0050 | <p>1.1.1.3. Einlagen, die höheren Abflüssen unterliegen</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Artikel 25 Absätze 2 und 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier den Gesamtsaldo der höheren Abflussraten unterliegenden Einlagen gemäß Artikel 25 Absatz 2 und 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. Privatkundeneinlagen, bei denen die Bewertung gemäß Artikel 25 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 bezüglich ihrer Kategorisierung nicht durchgeführt wurde oder nicht abgeschlossen ist, werden ebenfalls hier gemeldet.</p> |
| 0060 | <p>1.1.1.3.1. Kategorie 1</p> <p>Artikel 25 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Gesamtsaldos aller Privatkundeneinlagen, die die Kriterien in Artikel 25 Absatz 2 Buchstabe a oder zwei der Kriterien in Artikel 25 Absatz 2 Buchstaben b bis e der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, außer wenn diese Einlagen in Drittländern gehalten werden, bei denen gemäß Artikel 25 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 eine höhere Abflussrate angewendet wird, sodass sie in dieser letztgenannten Kategorie gemeldet werden müssen.</p> <p>Die Kreditinstitute melden als anwendbare Gewichtung den Durchschnitt der Raten, und zwar entweder die standardmäßig vorgesehenen Standardraten gemäß Artikel 25 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 oder höhere Raten, sofern diese von einer zuständigen Behörde angewendet werden, die effektiv auf den vollen Betrag aller im vorherigen Absatz genannten Einlagen angewendet und mit den genannten jeweiligen Beträgen gewichtet wurden.</p> |
| 0070 | <p>1.1.1.3.2. Kategorie 2</p> <p>Artikel 25 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Gesamtsaldos aller Privatkundeneinlagen, die die Kriterien in Artikel 25 Absatz 2 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 und mindestens ein weiteres Kriterium in Artikel 25 Absatz 2 oder mindestens drei Kriterien in Artikel 25 Absatz 2 erfüllen, außer wenn diese Einlagen in Drittländern gehalten werden, bei denen gemäß Artikel 25 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 eine höhere Abflussrate angewendet wird, sodass sie in dieser letztgenannten Kategorie gemeldet werden müssen.</p> <p>Privatkundeneinlagen, bei denen die Bewertung gemäß Artikel 25 Absatz 2 bezüglich ihrer Kategorisierung nicht durchgeführt wurde oder nicht abgeschlossen ist, werden ebenfalls hier gemeldet.</p> <p>Die Kreditinstitute melden als anwendbare Gewichtung den Durchschnitt der Raten, und zwar entweder die standardmäßig vorgesehenen Standardraten gemäß Artikel 25 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 oder höhere Raten, sofern diese von einer zuständigen Behörde angewendet werden, die auf den vollen Betrag aller in den vorherigen Absätzen genannten Einlagen</p> |

| | |
|------|---|
| | angewendet und mit den genannten jeweiligen Beträgen gewichtet wurden. |
| 0080 | <p>1.1.1.4. Stabile Einlagen</p> <p>Artikel 24 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Teil der Beträge der Privatkundeneinlagen, der durch ein Einlagensicherungssystem gemäß der Richtlinie 94/19/EG oder der Richtlinie 2014/49/EU oder ein gleichwertiges Einlagensicherungssystem in einem Drittland gedeckt ist und entweder Bestandteil einer etablierten Geschäftsbeziehung ist, sodass eine Entnahme äußerst unwahrscheinlich ist, oder auf einem Zahlungsverkehrskonto gehalten wird. Dies steht im Einklang mit Artikel 24 Absätze 2 und 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, wobei Folgendes gilt:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Diese Einlagen erfüllen nicht die in Artikel 25 Absätze 2, 3 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 niedergelegten Kriterien für eine höhere Abflussrate, in welchem Falle sie als höheren Abflüssen unterliegende Einlagen gemeldet werden müssten; oder — diese Einlagen werden nicht in Drittländern gehalten, bei denen gemäß Artikel 25 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 eine höhere Abflussrate angewendet wird, in welchem Falle sie in dieser Kategorie gemeldet werden müssten; — die in Artikel 24 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannte Ausnahmeregelung ist nicht anwendbar. |
| 0090 | <p>1.1.1.5. Stabile Einlagen mit angewandeter Ausnahmeregelung</p> <p>Artikel 24 Absätze 4 und 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Teil der Beträge der Privatkundeneinlagen, der durch ein Einlagensicherungssystem gemäß der Richtlinie 2014/49/EU bis zu einem Höchstbetrag von 100 000 EUR gedeckt ist und entweder Bestandteil einer etablierten Geschäftsbeziehung ist, sodass eine Entnahme äußerst unwahrscheinlich ist, oder auf einem Zahlungsverkehrskonto gehalten wird. Dies steht im Einklang mit Artikel 24 Absätze 2 und 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, wobei Folgendes gilt:</p> <p>Diese Einlagen erfüllen nicht die in Artikel 25 Absätze 2, 3 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 niedergelegten Kriterien für eine höhere Abflussrate, in welchem Falle sie als höheren Abflüssen unterliegende Einlagen gemeldet werden müssten; oder</p> <ul style="list-style-type: none"> — diese Einlagen werden nicht in Drittländern gehalten, bei denen gemäß Artikel 25 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 eine höhere Abflussrate angewendet wird, in welchem Falle sie in dieser Kategorie gemeldet werden müssten; — die in Artikel 24 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 vorgesehene Ausnahmeregelung ist anwendbar. |

| | |
|------|--|
| 0100 | <p>1.1.1.6. Einlagen in Drittländern, bei denen ein höherer Abfluss angewendet wird</p> <p>Artikel 25 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der Privatkundeneinlagen in Drittländern, bei denen gemäß den nationalen Rechtsvorschriften, die Liquiditätsanforderungen in dem jeweiligen Drittland begründen, ein höherer Abfluss angewendet wird.</p> |
| 0110 | <p>1.1.1.7. Andere Privatkundeneinlagen</p> <p>Artikel 25 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der anderen Privatkundeneinlagen, die nicht unter den vorherigen Posten erfasst wurden.</p> |
| 0120 | <p>1.1.2. Operative Einlagen</p> <p>Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den gemäß Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ermittelten Teil der operativen Einlagen, die für die Erbringung operativer Dienste erforderlich sind. Einlagen, die sich aus einer Korrespondenzbankbeziehung oder aus der Erbringung von Primebroker-Dienstleistungen ergeben, werden gemäß Artikel 27 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 nicht als operative Einlagen behandelt.</p> <p>Der Teil der operativen Einlagen, der den für die Erbringung operativer Dienste erforderlichen Teil übersteigt, wird nicht hier, sondern unter ID 1.1.3. gemeldet.</p> |
| 0130 | <p>1.1.2.1. Für Clearing-, Verwahr-, Gelddispositions- oder andere vergleichbare Dienstleistungen im Rahmen einer etablierten Geschäftsbeziehung gehalten</p> <p>Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 27 Absätze 2 und 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden Einlagen im Sinne des Artikels 27 Absatz 1 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, die vom Einleger gehalten werden, um Clearing-, Verwahr-, Gelddispositions- oder andere vergleichbare Dienstleistungen des Kreditinstituts im Rahmen einer etablierten Geschäftsbeziehung in Anspruch zu nehmen, welche im Sinne des Artikels 27 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 für den Einleger von entscheidender Bedeutung sind. Mittel, die über die für die Erbringung operativer Dienste erforderlichen Einlagen hinausgehen, werden als nicht operative Einlagen im Sinne von Artikel 27 Absatz 4 letzter Satz der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 behandelt.</p> <p>Gemeldet werden nur Einlagen im Sinne von Artikel 27 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, die mit erheblichen rechtlichen oder operativen Einschränkungen verbunden sind, die erhebliche Abhebungen innerhalb von 30 Kalendertagen</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>unwahrscheinlich machen.</p> <p>Die Kreditinstitute weisen den Betrag dieser Einlagen, der im Sinne von Artikel 27 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 durch ein Einlagensicherungssystem oder ein gleichwertiges Einlagensicherungssystem eines Drittlands gedeckt ist, und den nicht entsprechend gedeckten Betrag gemäß den folgenden Erläuterungen gesondert aus.</p> |
| 0140 | <p>1.1.2.1.1. Durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt</p> <p>Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 27 Absätze 2 und 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Teil des offenen Saldos der operativen Einlagen, die im Rahmen einer etablierten Geschäftsbeziehung, die die Kriterien gemäß Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 27 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt, gehalten werden und durch ein Einlagensicherungssystem gemäß der Richtlinie 94/19/EG oder der Richtlinie 2014/49/EU oder ein gleichwertiges Einlagensicherungssystem in einem Drittland gedeckt sind.</p> |
| 0150 | <p>1.1.2.1.2. Nicht durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt</p> <p>Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 27 Absätze 2 und 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Teil des offenen Saldos der operativen Einlagen, die im Rahmen einer etablierten Geschäftsbeziehung, die die Kriterien gemäß Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 27 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt, gehalten werden und nicht durch ein Einlagensicherungssystem gemäß der Richtlinie 94/19/EG oder der Richtlinie 2014/49/EU oder ein gleichwertiges Einlagensicherungssystem in einem Drittland gedeckt sind.</p> |
| 0160 | <p>1.1.2.2. In einem institutsbezogenen Sicherungssystem (IPS) oder Genossenschaftsverbund gehalten</p> <p>Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe b und Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier Einlagen, die gemäß Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gehalten werden im Kontext der gemeinsamen Aufgabenteilung innerhalb eines institutsbezogenen Sicherungssystems gemäß den Anforderungen des Artikels 113 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder innerhalb einer Gruppe von genossenschaftlichen Kreditinstituten, die einer Zentralorganisation ständig zugeordnet sind, die den Anforderungen des Artikels 113 Absatz 6 der genannten Verordnung entspricht, oder als eine gesetzlich oder vertraglich festgelegte Mindesteinlage eines anderen Kreditinstituts, das demselben institutsbezogenen Sicherungssystem oder Genossenschaftsverbund angeschlossen ist.</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Die Kreditinstitute weisen diese Einlagen in verschiedenen Zeilen aus, je nachdem, ob sie gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut behandelt werden oder nicht.</p> |
| 0170 | <p>1.1.2.2.1. Nicht als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut behandelt</p> <p>Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der Einlagen, die im Rahmen eines Genossenschaftsverbands oder institutsbezogenen Sicherungssystems gemäß den Kriterien in Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gehalten werden, sofern diese Einlagen nicht den liquiden Aktiva für das einlegende Kreditinstitut zugerechnet sind.</p> |
| 0180 | <p>1.1.2.2.2. Als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut behandelt</p> <p>Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe b und Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden Einlagen von Kreditinstituten bei dem Zentralinstitut, die gemäß Artikel 16 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva für das einlegende Kreditinstitut betrachtet werden.</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag dieser Einlagen bis zur Höhe der entsprechenden liquiden Aktiva nach Abschlag, wie in Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 festgelegt.</p> |
| 0190 | <p>1.1.2.3. Im Rahmen einer (anderen) etablierten Geschäftsbeziehung mit Nichtfinanzkunden gehalten</p> <p>Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe c und Artikel 27 Absätze 4 und 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der Einlagen, die von einem Nichtfinanzkunden im Rahmen einer anderen nicht unter Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannten etablierten Geschäftsbeziehung gehalten werden und den in Artikel 27 Absatz 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannten Anforderungen unterliegen.</p> <p>Gemeldet werden nur jene Einlagen, die mit erheblichen rechtlichen oder operativen Einschränkungen verbunden sind, die erhebliche Abhebungen innerhalb von 30 Kalendertagen unwahrscheinlich machen (gemäß Artikel 27 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61).</p> |
| 0200 | <p>1.1.2.4. Für die Zahlungsverkehrsabrechnung (Cash Clearing) und für Dienstleistungen eines Zentralinstituts innerhalb eines Verbunds gehalten</p> <p>Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe d und Artikel 27 Absatz 4 der</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der Einlagen, die vom Einleger für die Zahlungsverkehrsabrechnung (Cash Clearing) und für Dienstleistungen eines Zentralinstituts sowie für den Fall gehalten werden, dass das Kreditinstitut zu einem der in Artikel 16 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannten Verbunde bzw. Sicherungssysteme gehört, wie in Artikel 27 Absatz 1 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 dargelegt. Diese Zahlungsverkehrsabrechnungsdienstleistungen und Dienstleistungen eines Zentralinstituts decken gemäß Artikel 27 Absatz 4 Satz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 solche Dienste lediglich insoweit ab, als sie im Rahmen einer etablierten Geschäftsbeziehung erbracht werden, die für den Einleger von entscheidender Bedeutung ist; Mittel, die über die für die Erbringung operativer Dienste erforderlichen Einlagen hinausgehen, werden als nicht operative Einlagen im Sinne von Artikel 27 Absatz 4 letzter Satz der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 behandelt.</p> <p>Gemeldet werden nur jene Einlagen, die mit erheblichen rechtlichen oder operativen Einschränkungen verbunden sind, die erhebliche Abhebungen innerhalb von 30 Kalendertagen unwahrscheinlich machen (gemäß Artikel 27 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61).</p> |
| 0203 | <p>1.1.3 Überschüssige operative Einlagen</p> <p>Artikel 27 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den Teil der operativen Einlagen, der über die für die Erbringung operativer Dienste erforderlichen Mittel hinausgeht.</p> |
| 0204 | <p>1.1.3.1 Einlagen von Finanzkunden</p> <p>Artikel 27 Absatz 4 und Artikel 31a Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier weisen die Kreditinstitute den Teil der operativen Einlagen von Finanzkunden aus, der im Sinne von Artikel 27 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 über die für die Erbringung operativer Dienste erforderlichen Mittel hinausgeht.</p> |
| 0205 | <p>1.1.3.2 Einlagen von anderen Kunden</p> <p>Artikel 27 Absatz 4 und Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier weisen die Kreditinstitute den Teil der operativen Einlagen von anderen Kunden als Finanzkunden mit Ausnahme von Privatkundeneinlagen aus, der im Sinne von Artikel 27 Absatz 4 letzter Satz der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 über die für die Erbringung operativer Dienste erforderlichen Mittel hinausgeht.</p> <p>Diese überschüssigen operativen Einlagen werden in zwei verschiedenen Zeilen ausgewiesen, je nachdem, ob sie in voller Höhe durch ein Einlagensicherungssystem oder ein gleichwertiges</p> |

| | |
|------|--|
| | Einlagensicherungssystem eines Drittlands gedeckt sind oder nicht. |
| 0206 | <p>1.1.3.2.1 Durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt</p> <p>Artikel 27 Absatz 4 und Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den gesamten Betrag des offenen Saldos dieser überschüssigen operativen Einlagen, die von anderen Kunden gehalten werden, wenn dieser gesamte Betrag durch ein Einlagensicherungssystem gemäß der Richtlinie 94/19/EG oder der Richtlinie 2014/48/EG oder ein gleichwertiges Einlagensicherungssystem in einem Drittland gemäß Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gedeckt ist.</p> |
| 0207 | <p>1.1.3.2.2 Nicht durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt</p> <p>Artikel 27 Absatz 4 und Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den gesamten Betrag des offenen Saldos dieser überschüssigen operativen Einlagen, die von anderen Kunden gehalten werden, wenn dieser gesamte Betrag nicht durch ein Einlagensicherungssystem gemäß der Richtlinie 94/19/EG oder der Richtlinie 2014/48/EG oder ein gleichwertiges Einlagensicherungssystem in einem Drittland gemäß Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gedeckt ist.</p> |
| 0210 | <p>1.1.4. Nicht operative Einlagen</p> <p>Artikel 27 Absatz 5, Artikel 28 Absatz 1 und Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier unbesicherte Einlagen gemäß Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 sowie Einlagen, die sich aus einer Korrespondenzbankbeziehung oder aus der Erbringung von Primebroker-Dienstleistungen gemäß Artikel 27 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ergeben.</p> <p>Die Kreditinstitute weisen den Betrag der nicht operativen Einlagen, die durch ein Einlagensicherungssystem oder ein gleichwertiges Einlagensicherungssystem eines Drittlands gedeckt sind bzw. nicht gedeckt sind, wie in den folgenden Erläuterungen angegeben, mit Ausnahme der Verbindlichkeiten aus einer Korrespondenzbankbeziehung oder aus der Erbringung von Primebroker-Dienstleistungen gemäß Artikel 27 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 der Kommission, gesondert aus.</p> <p>Der Teil der operativen Einlagen, der die für die Erbringung operativer Dienste erforderlichen operativen Einlagen übersteigt, wird nicht hier, sondern unter ID 1.1.3. gemeldet.</p> |
| 0220 | <p>1.1.4.1. Einlagen, die sich aus einer Korrespondenzbankbeziehung oder aus der Erbringung von Primebroker-Dienstleistungen ergeben</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Artikel 27 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der Einlagen, die sich aus einer Korrespondenzbankbeziehung oder aus der Erbringung von Primebroker-Dienstleistungen gemäß Artikel 27 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ergeben.</p> |
| 0230 | <p>1.1.4.2. Einlagen von Finanzkunden</p> <p>Artikel 31a Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der Einlagen von Finanzkunden, sofern sie nicht als operative Einlagen gemäß Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 betrachtet werden.</p> |
| 0240 | <p>1.1.4.3. Einlagen von anderen Kunden</p> <p>Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden Einlagen, die von anderen Kunden (keinen Finanzkunden oder Kunden, die bei Privatkundeneinlagen berücksichtigt werden) gemäß Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gehalten werden, sofern sie nicht als operative Einlagen im Sinne des Artikels 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 betrachtet werden.</p> <p>Diese Einlagen werden in zwei verschiedenen Zeilen ausgewiesen, je nachdem, ob sie in voller Höhe durch ein Einlagensicherungssystem oder ein gleichwertiges Einlagensicherungssystem eines Drittlands gedeckt sind oder nicht.</p> |
| 0250 | <p>1.1.4.3.1. Nicht durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt</p> <p>Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den gesamten Betrag des offenen Saldos dieser Einlagen, die von anderen Kunden gehalten werden, wenn dieser gesamte Betrag durch ein Einlagensicherungssystem gemäß der Richtlinie 94/19/EG oder der Richtlinie 2014/48/EG oder ein gleichwertiges Einlagensicherungssystem in einem Drittland gemäß Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gedeckt ist.</p> |
| 0260 | <p>1.1.4.3.2. Nicht durch ein Einlagensicherungssystem (DGS) gedeckt</p> <p>Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den gesamten Betrag des offenen Saldos dieser Einlagen, die von anderen Kunden gehalten werden, wenn dieser gesamte Betrag nicht durch ein Einlagensicherungssystem gemäß der Richtlinie 94/19/EG oder der Richtlinie 2014/48/EG oder ein gleichwertiges Einlagensicherungssystem in einem Drittland gemäß Artikel 28 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gedeckt ist.</p> |
| 0270 | <p>1.1.5. Zusätzliche Abflüsse</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Artikel 30 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute zusätzliche Abflüsse gemäß Artikel 30 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Als Sicherheiten entgegengenommene Einlagen gelten nach Artikel 30 Absatz 7 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 der Kommission nicht als Verbindlichkeiten für die Zwecke der Artikel 24, 25, 27 oder 31a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, sondern unterliegen gegebenenfalls den Bestimmungen des Artikels 30 Absätze 1 bis 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0280 | <p>1.1.5.1. Andere Sicherheiten als für Derivate hinterlegte Aktiva der Stufe 1</p> <p>Artikel 30 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Marktwert von anderen Sicherheiten als Sicherheiten in Form von Aktiva der Stufe 1, die für die in Anhang II der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 aufgeführten Kontrakte sowie für Kreditderivate hinterlegt wurden.</p> |
| 0290 | <p>1.1.5.2. Für Derivate hinterlegte Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1</p> <p>Artikel 30 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Marktwert gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1, die für die in Anhang II der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 aufgeführten Kontrakte sowie für Kreditderivate hinterlegt wurden.</p> |
| 0300 | <p>1.1.5.3. Wesentliche Abflüsse infolge der Verschlechterung der eigenen Bonität</p> <p>Artikel 30 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Gesamtbetrag der zusätzlichen Abflüsse, die sie gemäß Artikel 30 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 berechnet und den zuständigen Behörden gemeldet haben.</p> <p>Wenn ein Betrag infolge einer Verschlechterung der eigenen Bonität anderweitig in einer Zeile mit einer Gewichtung von weniger als 100 % ausgewiesen wurde, wird dieser Betrag auch in Zeile 0300 gemeldet, sodass die Summe der Abflüsse für das Geschäft insgesamt 100 % beträgt.</p> |
| 0310 | <p>1.1.5.4. Auswirkungen ungünstiger Marktbedingungen auf die Derivatgeschäfte</p> <p>Artikel 30 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der nach der Delegierten Verordnung (EU) 2017/208 der Kommission berechneten Abflüsse.</p> |
| 0340 | <p>1.1.5.5. Abflüsse aus Derivaten</p> <p>Artikel 30 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Die Kreditinstitute melden den gemäß Artikel 21 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 berechneten Betrag der innerhalb von 30 Kalendertagen erwarteten Abflüsse aus den in Anhang II der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Kontrakten und aus Kreditderivaten.</p> <p>Nur im Falle von Meldungen in einer gesonderten Währung gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 melden die Kreditinstitute die Abflüsse, die nur in der jeweiligen signifikanten Währung auftreten. Die Aufrechnung (Netting) nach Gegenpartei darf nur bei Mittelflüssen in dieser Währung angewendet werden. Die Aufrechnung (Netting) nach Gegenpartei darf nur bei Mittelflüssen in dieser Währung angewendet werden. Beispiel: Gegenpartei A: +10 EUR und Gegenpartei A: -20 EUR wird als Abfluss von 10 EUR gemeldet. Zwischen verschiedenen Gegenparteien wird keine Aufrechnung vorgenommen. Beispiel: Gegenpartei A: -10 EUR, Gegenpartei B: +40 EUR wird als Abfluss von 10 EUR in C 73.00 (und Zufluss von 40 EUR in C 74.00) gemeldet.</p> |
| 0350 | <p>1.1.5.6. Leerverkaufspositionen</p> <p>Artikel 30 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hält das Kreditinstitut eine durch eine unbesicherte Wertpapierleihe gedeckte Leerverkaufsposition, sieht es einen zusätzlichen Liquiditätsabfluss vor, der 100 % des Marktwerts der Wertpapiere oder anderen Vermögenswerte entspricht, die leer verkauft werden, es sei denn, das Kreditinstitut hat sie zu Bedingungen geliehen, die ihre Rückgabe erst nach einem Zeitraum von 30 Kalendertagen erfordern. Ist die Leerverkaufsposition durch ein besichertes Wertpapierfinanzierungsgeschäft gedeckt, so geht das Kreditinstitut davon aus, dass die Leerverkaufsposition während des gesamten Zeitraums von 30 Kalendertagen beibehalten wird, und setzt den Abfluss mit 0 % an.</p> |
| 0360 | <p>1.1.5.6.1. Durch besicherte Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT) gedeckt</p> <p>Artikel 30 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Marktwert von Wertpapieren oder anderen Vermögenswerten, die leer verkauft wurden, durch besicherte Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gedeckt sind und innerhalb eines Zeithorizonts von 30 Kalendertagen zu liefern sind, es sei denn, das Kreditinstitut hat diese zu Bedingungen geliehen, die ihre Rückgabe erst nach einem Zeithorizont von 30 Kalendertagen erfordern.</p> |
| 0370 | <p>1.1.5.6.2. Sonstige</p> <p>Artikel 30 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Marktwert von Wertpapieren oder anderen Vermögenswerten, die leer verkauft wurden und nicht durch besicherte Wertpapierfinanzierungsgeschäfte gedeckt sind und innerhalb eines Zeithorizonts von 30 Kalendertagen zu liefern sind, es</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>sei denn, das Kreditinstitut hat diese zu Bedingungen geliehen, die ihre Rückgabe erst nach einem Zeithorizont von 30 Kalendertagen erfordern.</p> |
| 0380 | <p>1.1.5.7. Einforderbare überschüssige Sicherheiten</p> <p>Artikel 30 Absatz 6 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Marktwert der von dem Kreditinstitut gehaltenen überschüssigen Sicherheiten, die vertragsgemäß jederzeit von der Gegenpartei eingefordert werden können.</p> |
| 0390 | <p>1.1.5.8. Fällige Sicherheiten</p> <p>Artikel 30 Absatz 6 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Marktwert der Sicherheiten, die innerhalb von 30 Kalendertagen bei einer Gegenpartei hinterlegt werden müssen.</p> |
| 0400 | <p>1.1.5.9. Sicherheiten in Form liquider Aktiva, die durch nicht liquide Aktiva ersetzt werden können</p> <p>Artikel 30 Absatz 6 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Marktwert der Sicherheiten, die im Sinne des Titels II als liquide Aktiva anerkannt werden, und ohne Zustimmung des Kreditinstituts durch Vermögenswerte ersetzt werden können, die im Sinne des Titels II nicht als liquide Aktiva anerkannt würden.</p> |
| 0410 | <p>1.1.5.10. Verlust an Finanzmitteln aus strukturierten Finanzierungsinstrumenten</p> <p>Artikel 30 Absätze 8 bis 10 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute setzen einen Abfluss von 100 % für den Verlust an Finanzmitteln aus forderungsgedeckten Wertpapieren, gedeckten Schuldverschreibungen und anderen strukturierten Finanzierungsinstrumenten an, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden und vom Kreditinstitut selbst oder von geförderten Conduits oder Zweckgesellschaften begeben wurden.</p> <p>Kreditinstitute, die hier gemeldete Liquiditätsfazilitäten in Verbindung mit Finanzierungsprogrammen anbieten, müssen das fällig werdende Finanzierungsinstrument und die Liquiditätsfazilität für konsolidierte Programme nicht doppelt erfassen.</p> |
| 0420 | <p>1.1.5.10.1. Strukturierte Finanzierungsinstrumente</p> <p>Artikel 30 Absatz 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den aktuell ausstehenden Betrag an eigenen Verbindlichkeiten oder Verbindlichkeiten von geförderten Conduits oder Zweckgesellschaften aus forderungsgedeckten Wertpapieren, gedeckten Schuldverschreibungen und anderen strukturierten Finanzierungsinstrumenten, die innerhalb von</p> |

| | |
|------|---|
| | 30 Kalendertagen fällig werden. |
| 0430 | <p>1.1.5.10.2. Finanzierungsfazilitäten</p> <p>Artikel 30 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den fällig werdenden Betrag der Verbindlichkeiten aus forderungsgedeckten Geldmarktpapieren, Conduits, Wertpapier-Anlageinstrumenten und anderen derartigen Finanzierungsfazilitäten, sofern sich nicht unter die Begriffsbestimmung der Instrumente unter Posten 1.1.5.10.1. fallen, oder den Betrag der Vermögenswerte, bei denen die Möglichkeit besteht, dass sie zurückgegeben werden oder die Liquidität benötigt wird.</p> <p>Alle Finanzmittel aus forderungsgedeckten Geldmarktpapieren, Conduits, Wertpapier-Anlageinstrumenten und anderen derartigen Finanzierungsfazilitäten, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden oder zurückgegeben werden können. Kreditinstitute mit strukturierten Finanzierungsfazilitäten, die die Emission von kurzfristigen Schuldtiteln umfassen, wie z. B. forderungsgedekte Geldmarktpapiere, melden die potenziellen Liquiditätsabflüsse aus diesen Strukturen. Dazu zählen insbesondere: i) die Unfähigkeit, fällige Schulden zu refinanzieren, ii) die Existenz von Derivaten oder derivatähnlichen Komponenten, die vertraglich in den zugehörigen Unterlagen der Struktur niedergelegt ist, wonach die „Rückgabe“ der Vermögenswerte innerhalb einer Finanzierungsvereinbarung gestattet wäre, oder von dem ursprünglichen Übertragenden des Vermögenswerts verlangt wird, Liquidität zur Verfügung zu stellen, wobei die Finanzierungsvereinbarung („Liquidity Put“) innerhalb der 30-Tage-Frist effektiv endet. Wenn die strukturierten Finanzierungen durch eine Zweckgesellschaft (wie z. B. Vehikelgesellschaft, Conduit oder strukturiertes Anlageinstrument) durchgeführt werden, überprüft das Kreditinstitut bei der Ermittlung der Anforderungen bezüglich der erstklassigen liquiden Aktiva die Fälligkeit der von der Gesellschaft begebenen Schuldtitel sowie etwaiger eingebetteter Optionen in Finanzierungsvereinbarungen, durch die die „Rückgabe“ von Vermögenswerten oder der Liquiditätsbedarf, ungeachtet davon, ob die Zweckgesellschaft konsolidiert ist oder nicht, potenziell ausgelöst werden kann.</p> |
| 0450 | <p>1.1.5.11. Interne Aufrechnung der Positionen von Kunden</p> <p>Artikel 30 Absatz 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den Marktwert der nicht liquiden Vermögenswerte eines Kunden, die das Institut im Zusammenhang mit der Erbringung von Primebroker-Dienstleistungen verwendet hat, um durch internes Matching die Leerverkäufe eines anderen Kunden zu decken.</p> |
| 0460 | <p>1.1.6. Zugesagte Fazilitäten</p> <p>Artikel 31 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Die Kreditinstitute melden hier Abflüsse gemäß Artikel 31 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier auch Abflüsse aus zugesagten Fazilitäten gemäß Artikel 29 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Der Höchstbetrag, der in Anspruch genommen werden kann, wird gemäß Artikel 31 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 bestimmt.</p> |
| 0470 | <p>1.1.6.1. Kreditfazilitäten</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier zugesagte Kreditfazilitäten im Sinne des Artikels 31 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0480 | <p>1.1.6.1.1. Für Privatkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Kreditfazilitäten für Privatkunden in Anspruch genommen werden könnte, wie in Artikel 411 Nummer 2 der Verordnung (EU) 575/2013 festgelegt.</p> |
| 0490 | <p>1.1.6.1.2. Für andere Nichtfinanzkunden als Privatkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Kreditfazilitäten für Kunden, bei denen es sich weder um Finanzkunden gemäß Artikel 411 Nummer 1 der Verordnung (EU) 575/2013 noch um Privatkunden gemäß Artikel 411 Nummer 2 der Verordnung (EU) 575/2013 handelt, in Anspruch genommen werden könnte, wobei diese nicht zu dem Zweck bereitgestellt wurden, die Finanzierung des Kunden in Situationen zu ersetzen, in denen der Kunde den Finanzierungsbedarf nicht an den Finanzmärkten decken kann.</p> |
| 0500 | <p>1.1.6.1.3. Für Kreditinstitute</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier zugesagte Kreditfazilitäten, die Kreditinstituten gewährt wurden.</p> |
| 0510 | <p>1.1.6.1.3.1. Zur Finanzierung von Förderdarlehen für Privatkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Kreditfazilitäten in Anspruch genommen werden könnte, die Kreditinstituten zum alleinigen Zweck der direkten oder indirekten Finanzierung von Förderdarlehen gewährt werden, wobei diese als Risikopositionen gegenüber Kunden gemäß Artikel 411 Nummer 2 der Verordnung (EU) 575/2013 gelten.</p> <p>Dieser Posten kann nur von Kreditinstituten gemeldet werden, die vom Zentralstaat oder einer regionalen Gebietskörperschaft mindestens eines Mitgliedstaats eingerichtet wurden und gefördert werden.</p> |

| | |
|------|--|
| 0520 | <p>1.1.6.1.3.2. Zur Finanzierung von Förderdarlehen für Nichtfinanzkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Kreditfazilitäten in Anspruch genommen werden könnte, die Kreditinstituten zum alleinigen Zweck der direkten oder indirekten Finanzierung von Förderdarlehen gewährt wurden, wobei diese als Risikopositionen gegenüber Kunden gelten, bei denen es sich weder um Finanzkunden gemäß Artikel 411 Nummer 1 der Verordnung (EU) 575/2013 noch um Privatkunden gemäß Artikel 411 Nummer 2 der Verordnung (EU) 575/2013 handelt.</p> <p>Dieser Posten kann nur von Kreditinstituten gemeldet werden, die vom Zentralstaat oder einer regionalen Gebietskörperschaft mindestens eines Mitgliedstaats eingerichtet wurden und gefördert werden.</p> |
| 0530 | <p>1.1.6.1.3.3. Sonstige</p> <p>Artikel 31 Absatz 8 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Kreditfazilitäten, die Kreditinstituten gewährt und nicht oben genannt wurden, in Anspruch genommen werden könnte.</p> |
| 0540 | <p>1.1.6.1.4. Für andere beaufsichtigte Finanzinstitute als Kreditinstitute</p> <p>Artikel 31 Absatz 8 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Kreditfazilitäten, die anderen beaufsichtigten Finanzinstitute als Kreditinstituten gewährt wurden, in Anspruch genommen werden könnte.</p> |
| 0550 | <p>1.1.6.1.5. In einer Gruppe oder einem institutsbezogenen Sicherungssystem, sofern bevorzugter Behandlung unterliegend</p> <p>Artikel 29 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Kreditfazilitäten in Anspruch genommen werden könnte, bei denen die Anwendung einer geringeren Abflussrate gemäß Artikel 29 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt wurde.</p> |
| 0560 | <p>1.1.6.1.6. In einem institutsbezogenen Sicherungssystem oder Genossenschaftsverbund, sofern als liquides Aktivum für das einlegende Institut behandelt</p> <p>Artikel 31 Absatz 7 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Zentralinstitute eines in Artikel 16 genannten Systems oder Verbunds melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen, einem angeschlossenen Kreditinstitut zugesagten Kreditfazilitäten in</p> |

| | |
|------|---|
| | Anspruch genommen werden könnte, sofern das angeschlossene Kreditinstitut die Fazilität nach Artikel 16 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum behandeln darf. |
| 0570 | <p>1.1.6.1.7. Für andere Finanzkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 8 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus anderen nicht gezogenen zugesagten Kreditfazilitäten als den oben gemeldeten, die anderen Finanzkunden gewährt wurden, in Anspruch genommen werden könnte.</p> |
| 0580 | <p>1.1.6.2. Liquiditätsfazilitäten</p> <p>Artikel 31 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier zugesagte Liquiditätsfazilitäten gemäß Artikel 31 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0590 | <p>1.1.6.2.1. Für Privatkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Liquiditätsfazilitäten für Privatkunden in Anspruch genommen werden könnte, wie in Artikel 411 Nummer 2 der Verordnung (EU) 575/2013 festgelegt.</p> |
| 0600 | <p>1.1.6.2.2. Für andere Nichtfinanzkunden als Privatkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Liquiditätsfazilitäten für Kunden, bei denen es sich weder um Finanzkunden gemäß Artikel 411 Nummer 1 der Verordnung (EU) 575/2013 noch um Privatkunden gemäß Artikel 411 Nummer 2 der Verordnung (EU) 575/2013 handelt, in Anspruch genommen werden könnte.</p> |
| 0610 | <p>1.1.6.2.3. Für private Beteiligungsgesellschaften</p> <p>Artikel 31 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Liquiditätsfazilitäten, die privaten Beteiligungsgesellschaften gewährt wurden, in Anspruch genommen werden könnte.</p> |
| 0620 | <p>1.1.6.2.4. Für Verbriefungszweckgesellschaften (SSPE)</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier zugesagte Liquiditätsfazilitäten, die Verbriefungszweckgesellschaften gewährt wurden.</p> |
| 630 | <p>1.1.6.2.4.1. Für den Erwerb anderer Vermögenswerte als Wertpapiere von Nichtfinanzkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag von nicht gezogenen</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>zugesagten Liquiditätsfazilitäten, die einer Verbriefungszweckgesellschaft zur Verfügung gestellt wurde, damit sie andere Vermögenswerte als Wertpapiere von Kunden, die keine Finanzkunden sind, erwerben kann, insoweit er den Betrag der aktuell von Kunden erworbenen Vermögenswerte übersteigt, und sofern der Höchstbetrag, der in Anspruch genommen werden kann, vertraglich auf den Betrag der aktuell erworbenen Vermögenswerte begrenzt ist.</p> |
| 0640 | <p>1.1.6.2.4.2. Sonstige</p> <p>Artikel 31 Absatz 8 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Liquiditätsfazilitäten, die Verbriefungszweckgesellschaft aus anderen als den oben genannten Gründen gewährt wurden, in Anspruch genommen werden könnte. Dies umfasst Vereinbarungen, bei denen das Institut Vermögenswerte einer Verbriefungszweckgesellschaft kaufen oder tauschen muss.</p> |
| 0650 | <p>1.1.6.2.5. Für Kreditinstitute</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier zugesagte Liquiditätsfazilitäten, die Kreditinstituten gewährt wurden.</p> |
| 0660 | <p>1.1.5.2.5.1. Zur Finanzierung von Förderdarlehen für Privatkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Liquiditätsfazilitäten in Anspruch genommen werden könnte, die Kreditinstituten zum alleinigen Zweck der direkten oder indirekten Finanzierung von Förderdarlehen gewährt werden, wobei diese als Risikopositionen gegenüber Kunden gemäß Artikel 411 Nummer 2 der Verordnung (EU) 575/2013 gelten.</p> <p>Dieser Posten kann nur von Kreditinstituten gemeldet werden, die vom Zentralstaat oder einer regionalen Gebietskörperschaft mindestens eines Mitgliedstaats eingerichtet wurden und gefördert werden.</p> |
| 0670 | <p>1.1.6.2.5.2. Zur Finanzierung von Förderdarlehen für Nichtfinanzkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Liquiditätsfazilitäten in Anspruch genommen werden könnte, die Kreditinstituten zum alleinigen Zweck der direkten oder indirekten Finanzierung von Förderdarlehen gewährt wurden, wobei diese als Risikopositionen gegenüber Kunden gelten, bei denen es sich weder um Finanzkunden gemäß Artikel 411 Nummer 1 der Verordnung (EU) 575/2013 noch um Privatkunden gemäß Artikel 411 Nummer 2 der Verordnung (EU) 575/2013 handelt.</p> <p>Dieser Posten kann nur von Kreditinstituten gemeldet werden, die vom Zentralstaat oder einer regionalen Gebietskörperschaft</p> |

| | |
|------|---|
| | mindestens eines Mitgliedstaats eingerichtet wurden und gefördert werden. |
| 0680 | <p>1.1.6.2.5.3. Sonstige</p> <p>Artikel 31 Absatz 8 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Liquiditätsfazilitäten, die Kreditinstituten gewährt und nicht oben genannt wurden, in Anspruch genommen werden könnte.</p> |
| 0690 | <p>1.1.6.2.6. In einer Gruppe oder einem institutsbezogenen Sicherungssystem, sofern bevorzugter Behandlung unterliegend</p> <p>Artikel 29 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Liquiditätsfazilitäten in Anspruch genommen werden könnte, bei denen die Anwendung einer geringeren Abflussrate gemäß Artikel 29 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt wurde.</p> |
| 0700 | <p>1.1.6.2.7. In einem institutsbezogenen Sicherungssystem oder Genossenschaftsverbund, sofern als liquides Aktivum für das einlegende Institut behandelt</p> <p>Artikel 31 Absatz 7 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Zentralinstitute eines in Artikel 16 genannten Systems oder Verbunds melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen, einem angeschlossenen Kreditinstitut zugesagten Liquiditätsfazilitäten in Anspruch genommen werden könnte, sofern das angeschlossene Kreditinstitut die Fazilität nach Artikel 16 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/16 als liquides Aktivum behandeln darf.</p> |
| 0710 | <p>1.1.6.2.8. Für andere Finanzkunden</p> <p>Artikel 31 Absatz 8 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus anderen nicht gezogenen zugesagten Liquiditätsfazilitäten als den oben gemeldeten, die anderen Finanzkunden gewährt wurden, in Anspruch genommen werden könnte.</p> |
| 0720 | <p>1.1.7. Andere Produkte und Dienstleistungen</p> <p>Artikel 23 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier Produkte und Dienstleistungen gemäß Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Der zu meldende Betrag entspricht dem Höchstbetrag, der aus den in Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannten Produkten und Dienstleistungen in Anspruch genommen werden könnte.</p> <p>Die anwendbare Gewichtung entspricht der Gewichtung, die von den zuständigen Behörden gemäß Artikel 23 Absatz 2 der Delegierten</p> |

| | |
|------|--|
| | Verordnung (EU) 2015/61 bestimmt wurde. |
| 0731 | <p>1.1.7.1. Nicht zweckgebundene Finanzierungsfazilitäten</p> <p>Artikel 23 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der nicht zweckgebundenen Finanzierungsfazilitäten gemäß Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Garantien werden in dieser Zeile nicht gemeldet.</p> |
| 0740 | <p>1.1.7.2. Nicht in Anspruch genommene Darlehen und Buchkredite an Großkunden</p> <p>Artikel 23 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der nicht in Anspruch genommenen Darlehen und Buchkredite an Großkunden gemäß Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0750 | <p>1.1.7.3. Vereinbarte, aber noch nicht in Anspruch genommene Hypothekendarlehen</p> <p>Artikel 23 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der vereinbarten, aber noch nicht in Anspruch genommenen Hypothekendarlehen gemäß Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0760 | <p>1.1.7.4. Kreditkarten</p> <p>Artikel 23 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der Kreditkarten gemäß Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0770 | <p>1.1.7.5. Überziehungskredite</p> <p>Artikel 23 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der Überziehungskredite gemäß Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0780 | <p>1.1.7.6. Geplante Abflüsse in Zusammenhang mit der Verlängerung oder der Vergabe neuer Privat- oder Großkundenkredite</p> <p>Artikel 23 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der geplanten Abflüsse in Zusammenhang mit der Verlängerung oder der Vergabe neuer Privat- oder Großkundenkredite gemäß Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0850 | <p>1.1.7.7. Derivateverbindlichkeiten</p> <p>Artikel 23 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der in Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannten Derivateverbindlichkeiten, mit Ausnahme der in Anhang II der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 aufgeführten Kontrakte und</p> |

| | |
|------|---|
| | Kreditderivate. |
| 0860 | <p>1.1.7.8. Außerbilanzielle Posten für die Handelsfinanzierung</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag der Produkte oder Dienstleistungen im Zusammenhang mit den in Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannten außerbilanziellen Posten für die Handelsfinanzierung.</p> |
| 0870 | <p>1.1.7.9. Sonstige</p> <p>Artikel 23 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag von anderen als den oben genannten Produkten oder Dienstleistungen gemäß Artikel 23 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>In dieser Zeile werden unter anderem Garantien gemeldet.</p> <p>In dieser Zeile werden Eventualabflüsse aufgrund anderer Ereignisse gemeldet als der in Artikel 30 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannten Ereignisse, die eine Herabstufung auslösen.</p> |
| 0885 | <p>1.1.8. Andere Verbindlichkeiten und fällige Verpflichtungen</p> <p>Artikel 28 Absätze 2 und 6 und Artikel 31a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier Abflüsse aus anderen Verbindlichkeiten fälligen Verpflichtungen gemäß Artikel 28 Absätze 2 und 6 und Artikel 31a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 der Kommission.</p> <p>Dieser Posten umfasst gegebenenfalls auch zusätzliche Guthaben, die bei Zentralbankreserven gehalten werden müssen, soweit dies zwischen der zuständigen Behörde und der EZB oder der Zentralbank gemäß Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe b Ziffer iii der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 festgelegt wurde.</p> |
| 0890 | <p>1.1.8.1. Verbindlichkeiten aus Betriebskosten</p> <p>Artikel 28 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der Verbindlichkeiten aus den eigenen Betriebskosten des Kreditinstituts gemäß Artikel 28 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0900 | <p>1.1.8.2. In Form von Schuldverschreibungen, sofern nicht als Privatkundeneinlagen behandelt</p> <p>Artikel 28 Absatz 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der von dem Kreditinstitut begebenen Anleihen und anderen Schuldverschreibungen, die nicht den als Privatkundeneinlagen gemeldeten Anleihen und Schuldverschreibungen entsprechen, gemäß Artikel 28 Absatz 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. Dieser Betrag umfasst auch innerhalb der nächsten 30 Kalendertage fällig werdende Coupons in Bezug auf all diese</p> |

| | |
|------|--|
| | Wertpapiere. |
| 0912 | <p>1.1.8.4 Überschreitung der Finanzierung gegenüber Nichtfinanzkunden</p> <p>Artikel 31a Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute die Differenz zwischen den vertraglichen Verpflichtungen zur Ausreichung von Finanzierung gegenüber Nichtfinanzkunden und dem Betrag der Zuflüsse von solchen Kunden im Sinne von Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der vorgenannten Delegierten Verordnung, wenn der erstgenannte den letztgenannten Betrag überschreitet.</p> |
| 0913 | <p>1.1.8.4.1 Überschreitung der Finanzierung gegenüber Privatkunden</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute die Differenz zwischen den vertraglichen Verpflichtungen zur Ausreichung von Finanzierung gegenüber Privatkunden und dem Betrag der Zuflüsse von solchen Kunden im Sinne von Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, wenn der erstgenannte den letztgenannten Betrag überschreitet.</p> |
| 0914 | <p>1.1.8.4.2 Überschreitung der Finanzierung gegenüber Nichtfinanzkunden</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute die Differenz zwischen den vertraglichen Verpflichtungen zur Ausreichung von Finanzierung gegenüber Nichtfinanzkunden und dem Betrag der Zuflüsse von solchen Firmenkunden im Sinne von Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, wenn der erstgenannte den letztgenannten Betrag überschreitet.</p> |
| 0915 | <p>1.1.8.4.3 Überschreitung der Finanzierung gegenüber Staaten, multilateralen Entwicklungsbanken und öffentlichen Stellen</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute die Differenz zwischen den vertraglichen Verpflichtungen zur Ausreichung von Finanzierung gegenüber Staaten, multilateralen Entwicklungsbanken und öffentlichen Stellen und den Betrag der Zuflüsse von solchen Kunden im Sinne von Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, wenn der erstgenannte den letztgenannten Betrag überschreitet.</p> |
| 0916 | <p>1.1.8.4.4 Überschreitung der Finanzierung gegenüber anderen juristischen Personen</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute die Differenz zwischen den vertraglichen Verpflichtungen zur Ausreichung von Finanzierung gegenüber anderen juristischen Personen und dem Betrag der Zuflüsse von solchen Kunden im Sinne von Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, wenn der erstgenannte den letztgenannten Betrag überschreitet.</p> |
| 0917 | <p>1.1.8.5 Vermögenswerte, die auf unbesicherter Basis geliehen wurden</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Artikel 28 Absatz 7 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier Vermögenswerte, die auf unbesicherter Basis geliehen wurden und innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden. Es wird davon ausgegangen, dass diese Vermögenswerte vollständig auslaufen, was zu einem 100%igen Abfluss führt.</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Marktwert der Vermögenswerte, die auf unbesicherter Basis geliehen wurden und innerhalb der 30-Tage-Frist fällig werden, sofern das Kreditinstitut nicht Eigentümer der Wertpapiere ist und sie nicht Teil des Liquiditätspuffers des Kreditinstituts sind.</p> |
| 0918 | <p>1.1.8.6 Sonstige</p> <p>Artikel 31a Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der innerhalb der nächsten 30 Kalendertage fällig werdenden Verbindlichkeiten, die nicht den in den Artikeln 24 bis 31 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genannten Verbindlichkeiten entsprechen.</p> <p>In dieser Zeile werden nur jegliche sonstigen Abflüsse aus unbesicherten Geschäften gemeldet. Besicherte Geschäfte werden unter ID 1.2. „Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen“ und unter ID 1.3. „Summe der Abflüsse aus Sicherheitenswaps“ gemeldet.</p> |
| 0920 | <p>1.2. Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen gemäß Artikel 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Sicherheitenswapgeschäfte (die Sicherheitentauschgeschäfte abdecken) werden im Meldebogen C 75.01 in Anhang XXIV gemeldet.</p> |
| 0930 | <p>1.2.1. Gegenpartei ist Zentralbank</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen gemäß Artikel 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist.</p> |
| 0940 | <p>1.21.1. Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>ausgereichten Sicherheiten um Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 10 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0945 | <p>1.2.1.1 Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.1.1, bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0950 | <p>1.2.1.2. Sicherheiten der Stufe 1 in Form von Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 10 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0955 | <p>1.2.1.2.1 Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.1.2., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0960 | <p>1.2.1.3. Sicherheiten der Stufe 2A</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um Aktiva der Stufe 2A handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 11 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0965 | <p>1.2.1.3.1 Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.1.3., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0970 | <p>1.2.1.4. Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen der Stufe 2B handelt, die durch Wohnimmobilien oder Kraftfahrzeuge unterlegt sind und der Bonitätsstufe 1 entsprechen und außerdem die Bedingungen gemäß Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe b Ziffern i, ii oder iv erfüllen und — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0975 | <p>1.2.1.4.1 Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.1.4., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0980 | <p>1.2.1.5. Gedeckte Schuldverschreibungen der Stufe 2B</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B handelt, die die Bedingungen gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe e erfüllen und die — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0985 | <p>1.2.1.5.1 Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.1.5., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0990 | <p>1.2.1.6. Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen der Stufe 2B handelt, die durch Darlehen zu Marktbedingungen, Leasings und für Unternehmen geschaffene Kreditfazilitäten oder Darlehen und Kreditfazilitäten für in einem Mitgliedstaat ansässige natürliche Personen abgesichert sind und der Bonitätsstufe 1 entsprechen und außerdem die Bedingungen gemäß Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern iii oder v erfüllen und — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 0995 | <p>1.2.1.6.1 Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.1.6., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1000 | <p>1.2.1.7. Andere Sicherheiten in Form von Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um oben nicht erfasste Aktiva der Stufe 2B handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1005 | <p>1.2.1.7.1. Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.1.7., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1010 | <p>1.2.1.8. Sicherheiten in Form nicht liquider Aktiva</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen gemäß Artikel 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten</p> |

| | |
|------|--|
| | Sicherheiten um nicht liquide Aktiva handelt. |
| 1020 | <p>1.2.2. Gegenpartei ist keine Zentralbank</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen gemäß Artikel 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist.</p> |
| 1030 | <p>1.2.2.1. Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 10 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1035 | <p>1.2.2.1.1. Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.2.1., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1040 | <p>1.2.2.2. Sicherheiten der Stufe 1 in Form von Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 10 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1045 | <p>1.2.2.2.1. Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.2.2., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |

| | |
|------|---|
| 1050 | <p>1.2.2.3. Sicherheiten der Stufe 2A</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 2A handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 11 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1055 | <p>1.2.2.3.1. Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.2.3., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1060 | <p>1.2.2.4. Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen der Stufe 2B handelt, die durch Wohnimmobilien oder Kraftfahrzeuge unterlegt sind und der Bonitätsstufe 1 entsprechen und außerdem die Bedingungen gemäß Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern i, ii oder iv erfüllen und — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1065 | <p>1.2.2.4.1. Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.2.4., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1070 | <p>1.2.2.5. Gedeckte Schuldverschreibungen der Stufe 2B</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe e der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und es sich bei den</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>ausgereichten Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B handelt, die die Bedingungen gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe e erfüllen und die — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1075 | <p>1.2.2.5.1. Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.2.5., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1080 | <p>1.2.2.6. Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe f der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen der Stufe 2B handelt, die durch Darlehen zu Marktbedingungen, Leasings und für Unternehmen geschaffene Kreditfazilitäten oder Darlehen und Kreditfazilitäten für in einem Mitgliedstaat ansässige natürliche Personen abgesichert sind und der Bonitätsstufe 1 entsprechen und außerdem die Bedingungen gemäß Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe f Ziffern iii oder v erfüllen und — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1085 | <p>1.2.2.6.1. Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.2.6., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1090 | <p>1.2.2.7. Andere Sicherheiten in Form von Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe g der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne des Artikels 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um oben nicht erfasste Sicherheiten der Stufe 2B handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit bei diesen</p> |

| | |
|----------------------------|---|
| | Geschäften verwendet — nach den Artikeln 7 und 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden. |
| 1095 | <p>1.2.2.7.1. Davon: Ausgereichte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Geschäfte unter 1.2.2.7., bei denen die Sicherheiten — würden sie nicht als Sicherheiten bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva gelten würden.</p> |
| 1100 | <p>1.2.2.8. Sicherheiten in Form nicht liquider Aktiva</p> <p>Artikel 28 Absatz 3 Buchstabe h der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier Abflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen gemäß Artikel 192 Absätze 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und Sicherheiten in Form nicht liquider Aktiva als Sicherheiten hinterlegt wurden.</p> |
| 1130 | <p>1.3. Summe der Abflüsse aus Sicherheitenswaps</p> <p>Die Summe der Abflüsse aus Spalte 0070 des Meldebogens C 75.01 in Anhang XXIV wird in Spalte 0060 gemeldet.</p> |
| ZUSATZINFORMATIONEN | |
| 1170 | <p>2. Liquiditätsabflüsse, die mit den einhergehenden Zuflüssen saldiert werden müssen</p> <p>Artikel 26 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0010 den offenen Saldo aller Verbindlichkeiten und außerbilanziellen Verpflichtungen, bei denen die Liquiditätsabflüsse gemäß Artikel 26 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 mit den einhergehenden Zuflüssen saldiert wurden.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Spalte 0060 die Abflüsse, die gemäß Artikel 26 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 mit den zugehörigen Zuflüssen saldiert wurden.</p> |
| | <p>3. Operative Einlagen für Clearing-, Verwahr-, Gelddispositions- oder andere vergleichbare Dienstleistungen im Rahmen einer etablierten Geschäftsbeziehung</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier operative Einlagen, auf die unter Posten</p> <p>1.1.2.1. verwiesen wird, aufgeschlüsselt nach den folgenden Gegenparteien:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Kreditinstitute; — andere Finanzkunden als Kreditinstitute; — Staaten, Zentralbanken, multilaterale Entwicklungsbanken und öffentliche Stellen; — andere Kunden. |

| | |
|------|---|
| 1180 | <p>3.1. Durch Kreditinstitute bereitgestellt</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der unter Posten 1.1.2.1. ausgewiesenen operativen Einlagen, die durch Kreditinstitute bereitgestellt wurden.</p> |
| 1190 | <p>3.2. Durch andere Finanzkunden als Kreditinstitute bereitgestellt</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der unter Posten 1.1.2.1. ausgewiesenen operativen Einlagen, die durch andere Finanzkunden als Kreditinstitute bereitgestellt wurden.</p> |
| 1200 | <p>3.3. Durch Staaten, Zentralbanken, multilaterale Entwicklungsbanken und öffentliche Stellen bereitgestellt</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der unter Posten 1.1.2.1. ausgewiesenen operativen Einlagen, die durch Staaten, Zentralbanken, multilaterale Entwicklungsbanken und öffentliche Stellen bereitgestellt wurden.</p> |
| 1210 | <p>3.4. Durch andere Kunden bereitgestellt</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Betrag des offenen Saldos der unter Posten 1.1.2.1. ausgewiesenen operativen Einlagen, die durch andere Kunden bereitgestellt wurden (ausgenommen die oben genannten Kunden und Kunden, die bei Privatkundeneinlagen berücksichtigt werden).</p> |
| | <p>4. Abflüsse innerhalb gruppeninterner und institutsinterner Sicherungssysteme</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier alle unter Posten 1 gemeldeten Geschäfte, bei denen die Gegenpartei das Mutter- oder Tochterinstitut des Kreditinstituts oder ein anderes Tochterunternehmen desselben Mutterinstituts ist oder mit dem Kreditinstitut durch eine Beziehung im Sinne des Artikels 12 Absatz 1 der Richtlinie 83/349/EWG verbunden oder Mitglied desselben institutsbezogenen Sicherungssystems gemäß Artikel 113 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder das Zentralinstitut oder ein Mitglied eines Verbunds oder einer genossenschaftlichen Gruppe gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist.</p> |
| 1290 | <p>4.1. davon: für Finanzkunden</p> <p>Die Kreditinstitute melden den unter Posten 1.1. gemeldeten Gesamtbetrag für Finanzkunden im Anwendungsbereich von Posten 4.</p> |
| 1300 | <p>4.2. davon: für Nichtfinanzkunden</p> <p>Die Kreditinstitute melden den unter Posten 1.1. gemeldeten Gesamtbetrag für Nichtfinanzkunden im Anwendungsbereich von Posten 4.</p> |
| 1310 | <p>4.3. davon: besichert</p> <p>Die Kreditinstitute melden den unter Posten 1.2. gemeldeten Gesamtbetrag der besicherten Geschäfte im Anwendungsbereich von</p> |

| | |
|------|--|
| | Posten 4. |
| 1320 | <p>4.4. davon: Kreditfazilitäten ohne bevorzugte Behandlung</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Kreditfazilitäten, die unter Posten 1.1.6.1. für Stellen im Anwendungsbereich von Posten 4 gemeldet wurden, in Anspruch genommen werden könnte, bei denen die Anwendung einer geringeren Abflussrate gemäß Artikel 29 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 nicht genehmigt wurde.</p> |
| 1330 | <p>4.5. davon: Liquiditätsfazilitäten ohne bevorzugte Behandlung</p> <p>Die Kreditinstitute melden den Höchstbetrag, der aus nicht gezogenen zugesagten Liquiditätsfazilitäten, die unter Posten 1.1.6.2. für Stellen im Anwendungsbereich von Posten 4 gemeldet wurden, in Anspruch genommen werden könnte, bei denen die Anwendung einer geringeren Abflussrate gemäß Artikel 29 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 nicht genehmigt wurde.</p> |
| 1340 | <p>4.6. davon: Operative Einlagen</p> <p>Die Kreditinstitute melden den unter Posten 1.1.2. gemeldeten Gesamtbetrag für Stellen im Anwendungsbereich von Posten 4.</p> |
| 1345 | <p>4.7. davon: überschüssige operative Einlagen Die Kreditinstitute melden den unter Posten 1.1.3. gemeldeten Gesamtbetrag für Stellen im Anwendungsbereich von Posten 4.</p> |
| 1350 | <p>4.8. davon: nicht operative Einlagen</p> <p>Die Kreditinstitute melden den unter Posten 1.1.4. gemeldeten offenen Saldo der Einlagen von Stellen im Anwendungsbereich von Posten 4.</p> |
| 1360 | <p>4.9. davon: Verbindlichkeiten in Form von Schuldverschreibungen, sofern nicht als Privatkundeneinlagen behandelt</p> <p>Die Kreditinstitute melden den unter Posten 1.1.8.2. gemeldeten offenen Saldo der Schuldverschreibungen, die von Stellen im Anwendungsbereich von Posten 4 gehalten werden.</p> |
| 1370 | <p>5. Fremdwährungsabflüsse</p> <p>Dieser Posten wird nur im Falle von Meldungen in Währungen, die getrennten Berichterstattung unterliegen, ausgewiesen.</p> <p>Nur im Falle von Meldungen in einer gesonderten Währung gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 melden die Kreditinstitute den Anteil der Abflüsse aus Derivaten (gemeldet unter 1.1.5.5.), die sich auf Fremdwährungs-Kapitalströme in der entsprechenden signifikanten Währung aus währungsübergreifenden Swaps sowie Devisenkassa- und -termingeschäften, die innerhalb der 30-Tage-Frist fällig werden, beziehen. Die Aufrechnung (Netting) nach Gegenpartei darf nur bei Mittelflüssen in dieser Währung angewendet werden. Beispiel: Gegenpartei A: +10 EUR und Gegenpartei A: -20 EUR wird als Abfluss von 10 EUR gemeldet.</p> |

| | |
|------|---|
| | Zwischen verschiedenen Gegenparteien wird keine Aufrechnung vorgenommen. Beispiel: Gegenpartei A: -10 EUR, Gegenpartei B: +40 EUR wird als Abfluss von 10 EUR in C 73.00 (und Zufluss von 40 EUR in C 74.00) gemeldet. |
| | <p>6. Von Artikel 17 Absätze 2 und 3 freigestellte besicherte Finanzierung</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Finanzierungsgeschäfte mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 1400 | <p>6.1 davon: besichert durch Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Finanzierungsgeschäfte, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit verwendet — die Anforderungen der Artikel 7 und 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen würden, und wenn die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 1410 | <p>6.2 davon: besichert durch gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Finanzierungsgeschäfte, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit verwendet — die Anforderungen der Artikel 7 und 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen würden, und wenn die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 1420 | <p>6.3 davon: besichert durch Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Finanzierungsgeschäfte, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 2A handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit verwendet — die Anforderungen der Artikel 7 und 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen würden, und wenn die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |

| | |
|------|--|
| | sind. |
| 1430 | <p>6.4 davon: besichert durch Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Finanzierungsgeschäfte, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den ausgereichten Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 2B handelt, die — würden sie nicht als Sicherheit verwendet — die Anforderungen der Artikel 7 und 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen würden, und wenn die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 1440 | <p>6.5 davon: besichert durch nicht liquide Aktiva</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Finanzierungsgeschäfte, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist, es sich bei der ausgereichten Sicherheit um eine nicht liquide Sicherheit handelt und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |

TEIL 3: ZUFLÜSSE

1. Zuflüsse

1.1. Allgemeine Bemerkungen

1. Dies ist ein zusammenfassender Meldebogen, in dem Angaben zu den über die nächsten 30 Tage gemessenen Liquiditätszuflüssen zu machen sind. Zweck ist die Meldung der Liquiditätsdeckungsanforderung gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. Posten, zu denen die Kreditinstitute keine Angaben machen müssen, sind grau hinterlegt.
2. Die Kreditinstitute übermitteln den Meldebogen in den entsprechenden Währungen gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) 575/2013.
3. Gemäß Artikel 32 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gilt für Liquiditätszuflüsse Folgendes:
 - i. Sie umfassen nur vertragliche Zuflüsse aus Risikopositionen, die nicht überfällig sind und hinsichtlich derer das Kreditinstitut keinen Grund zu der Annahme hat, dass sie innerhalb des Zeithorizonts von 30 Tagen nicht erfüllt werden.
 - ii. Sie werden berechnet durch Multiplikation der offenen Salden der verschiedenen Kategorien von vertraglichen Forderungen mit den in der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 festgelegten Raten.
4. Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems (ausgenommen Zuflüsse aus nicht in Anspruch genommenen Kredit- bzw. Liquiditätsfazilitäten, die durch Mitglieder einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems bereitgestellt wurden, wobei die zuständige Behörde die Anwendung einer günstigeren Zuflussrate genehmigt hat) werden den entsprechenden Kategorien zugeordnet. Nicht gewichtete Beträge werden außerdem als Zusatzinformationen in Abschnitt 3 des Meldebogens (Zeilen 0460 bis 0510) gemeldet.
5. Gemäß Artikel 32 Absatz 6 der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 2015/61 melden die Kreditinstitute keine Zuflüsse aus den im Einklang mit Titel II der genannten Verordnung gemeldeten liquiden Aktiva, ausgenommen fällige Zahlungen auf Aktiva, die nicht im Marktwert des Vermögenswerts berücksichtigt sind.
6. Zuflüsse, die in Drittländern eingehen sollen, in denen Transferbeschränkungen bestehen, oder die auf nichtkonvertierbare Währungen lauten, werden in den entsprechenden Zeilen der Abschnitte 1.1., 1.2. oder 1.3. gemeldet. Die Zuflüsse werden in vollem Umfang gemeldet, ungeachtet des Betrags der Abflüsse in dem Drittland oder in der Währung.
7. Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die vom Kreditinstitut selbst oder von einer Verbriefungszweckgesellschaft mit engen Verbindungen zu dem Kreditinstitut begeben wurden, werden auf Nettobasis mit einer Zuflussrate berücksichtigt, die auf der Grundlage der Zuflussrate angewendet wird, welche nach Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe h der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 für die zugrunde liegenden Vermögenswerte gilt.
8. Gemäß Artikel 32 Absatz 7 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 melden die Kreditinstitute keine Zuflüsse aus neu eingegangenen Verpflichtungen. Dies

betrifft vertragliche Verpflichtungen, die zum Meldestichtag noch nicht vertraglich begründet waren, sondern innerhalb von 30 Tagen eingegangen werden oder eingegangen werden könnten.

9. Im Falle einer gesonderten Meldung gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) 575/2013 umfassen die gemeldeten Salden nur die auf die maßgebliche Währung lautenden Salden, um sicherzustellen, dass Währungsabweichungen korrekt widerspiegelt werden. Dies kann bedeuten, dass nur eine Seite des Geschäfts im Meldebogen für die maßgebliche Währung ausgewiesen wird. Beispielsweise dürfen die Kreditinstitute gemäß Artikel 21 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 im Falle von Fremdwährungsderivaten die Zu- und Abflüsse nur dann auf Nettobasis berechnen, soweit sie auf dieselbe Währung lauten.
 10. Bei der Spaltenstruktur dieses Meldebogens werden die verschiedenen Obergrenzen der Zuflüsse berücksichtigt, die gemäß Artikel 33 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gelten. In dieser Hinsicht basiert der Meldebogen auf drei Gruppen von Spalten, einer Gruppe für jede Obergrenze (Obergrenze von 75 %, Obergrenze von 90 % und von der Obergrenze ausgenommen). Kreditinstitute, die auf konsolidierter Basis melden, können mehrere dieser Spalten-Gruppen verwenden, wenn mehrere Unternehmen im selben Konsolidierungskreis für verschiedene Obergrenzen infrage kommen.
 11. Gemäß Artikel 2 Absatz 3 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 in Bezug auf die Konsolidierung unterliegen Liquiditätszuflüsse in ein Tochterunternehmen in einem Drittland, für die nach dem nationalen Recht niedrigere Prozentsätze als die in Titel III der Verordnung gelten, der Konsolidierung gemäß den niedrigeren Sätzen in den nationalen Rechtsvorschriften des Drittlandes.
 12. In der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 wird nur auf Raten und Abschläge verwiesen. Durch den Begriff „Gewichtung“ in dem Meldebogen wird lediglich auf diese Begriffe im entsprechenden Kontext Bezug genommen. In diesem Anhang wird der Begriff „gewichtet“ als allgemeiner Begriff verwendet, um den Betrag anzugeben, der nach Anwendung der betreffenden Abschläge, Raten und anderen relevanten zusätzlichen Erläuterungen ermittelt wurde (z. B. im Falle von besicherter Kreditvergabe und Finanzierung).
 13. In den zugehörigen Meldebögen zu diesen Erläuterungen sind „Zusatzinformationen“ enthalten. Diese Angaben sind unter anderem notwendig, damit die zuständige Behörde die Einhaltung der Liquiditätsanforderungen durch die Kreditinstitute angemessen bewerten kann.
- 1.2. Besondere Bemerkungen in Bezug auf besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen
14. In dem Meldebogen werden besicherte Ab- und Zuflüsse durch die Anerkennungsfähigkeit der zugrunde liegenden Vermögenswerte oder erstklassigen liquiden Aktiva kategorisiert. Für Sicherheitenswaps ist ein separater Meldebogen vorgesehen: C 75.01 in Anhang XXIV. Sicherheitenswaps, bei denen es sich um Sicherheitentauschgeschäfte handelt, werden nicht im Meldebogen für Zuflüsse (C 74.00 in Anhang XXIV) gemeldet, der nur für Geschäfte Geld gegen Sicherheiten gilt.

15. Sind besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen durch Anteile oder Aktien an OGA besichert, werden diese Transaktionen so gemeldet, als seien sie durch die dem OGA zugrunde liegenden Vermögenswerte besichert. Ist beispielsweise eine besicherte Kreditvergabe durch Anteile oder Aktien an einem OGA besichert, der ausschließlich in Aktiva der Stufe 2A investiert, so wird die besicherte Kreditvergabe so gemeldet, als sei sie direkt durch Aktiva der Stufe 2A besichert. Die potenziell höhere Zuflussrate für besicherte Kreditvergaben, die durch Anteile oder Aktien an OGA besichert sind, muss sich in der jeweils zu meldenden Zuflussrate widerspiegeln.
 16. Im Falle einer gesonderten Meldung gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) 575/2013 umfassen die gemeldeten Salden nur die auf die maßgebliche Währung lautenden Salden, um sicherzustellen, dass Währungsabweichungen korrekt widerspiegelt werden. Dies kann bedeuten, dass nur eine Seite des Geschäfts im Meldebogen für die maßgebliche Währung ausgewiesen wird. Somit kann eine Anerkennungsfähigkeit zu einem negativen Zufluss führen. Die unter derselben Ziffer gemeldeten Reverse-Repo-Geschäfte werden addiert (Positiva und Negativa). Ist die Summe positiv, wird dies im Meldebogen für Zuflüsse ausgewiesen. Ist die Summe hingegen negativ, wird dies im Meldebogen für Abflüsse ausgewiesen. Dieser Ansatz wird bei Repo-Geschäften umgekehrt befolgt.
 17. Zur Berechnung der Zuflüsse werden besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen unabhängig davon gemeldet, ob die zugrunde liegende Sicherheit die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. Zur Berechnung des angepassten Bestands liquider Aktiva gemäß Artikel 17 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 melden die Kreditinstitute außerdem jene Transaktionen gesondert, bei denen die erhaltene Sicherheit zusätzlich die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.
 18. Wenn ein Kreditinstitut nur einen Teil seiner Aktien, Zentralstaat- oder Bankaktiva in Fremdwährung bzw. seiner Zentralstaat- oder Bankaktiva in Landeswährung innerhalb seiner erstklassigen liquiden Aktiva ansetzen kann, wird nur der ansetzbare Teil in den Zeilen für Aktiva der Stufen 1, 2A und 2B gemeldet (gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe c Ziffer ii) und Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61). Wird der betreffende Vermögenswert als Sicherheit verwendet, jedoch in einer Höhe, die den als liquide Aktiva ansetzbaren Teil übersteigt, wird der überschüssige Betrag in dem Abschnitt für nicht liquide Aktiva gemeldet. Aktiva der Stufe 2A werden in der entsprechenden Zeile für Aktiva der Stufe 2A ausgewiesen, selbst wenn der Alternative Liquiditätsansatz gemäß Artikel 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 befolgt wird.
- 1.3. Besondere Bemerkungen in Bezug auf Abwicklung und Forward-Geschäfte
19. Die Kreditinstitute melden Zuflüsse aus Forward-Repo-Geschäften, die innerhalb der 30 Tage-Frist beginnen und deren Fälligkeit außerhalb dieser 30 Tage-Frist liegt. Der zu empfangende Zufluss wird unter {C 74.00; r0260} („Andere Zuflüsse“) abzüglich des Marktwerts des an die Gegenpartei zu liefernden Vermögenswerts nach Anwendung des zugehörigen LCR Haircut ausgewiesen. Handelt es sich bei dem Vermögenswert nicht um ein „liquides Aktivum“, wird der zu empfangende Zufluss in vollem Umfang gemeldet. Der

als Sicherheit einzusetzende Vermögenswert wird im Meldebogen C 72.00 ausgewiesen, wenn das Kreditinstitut den Vermögenswert zum Stichtag in seinen Büchern führt und dieser die zugehörigen Bedingungen erfüllt.

20. Die Kreditinstitute melden Zuflüsse aus Forward- und Reverse-Repo-Geschäften sowie Sicherheitenwaps, die innerhalb der 30 Tage-Frist beginnen und deren Fälligkeit außerhalb dieser 30 Tage-Frist liegt, sofern die anfängliche Komponente zu einem Zufluss führt. Im Falle eines Repo-Geschäfts wird der zu empfangende Zufluss unter {C 74.00; r0260} („Andere Zuflüsse“) abzüglich des Marktwerts des an die Gegenpartei zu liefernden Vermögenswerts nach Anwendung des zugehörigen LCR Haircut ausgewiesen. Wenn der zu empfangende Betrag unter dem Marktwert des als Sicherheit auszuleihenden Vermögenswerts liegt (nach LCR Haircut), wird die Differenz im Meldebogen C 73.00 als Abfluss gemeldet. Handelt es sich bei dem Vermögenswert nicht um ein „liquides Aktivum“, wird der zu empfangende Zufluss in vollem Umfang gemeldet. Der als Sicherheit einzusetzende Vermögenswert wird im Meldebogen C 72.00 ausgewiesen, wenn das Kreditinstitut den Vermögenswert zum Stichtag in seinen Büchern führt und dieser die zugehörigen Bedingungen erfüllt. Im Falle eines Reverse-Repo-Geschäfts, bei dem der Marktwert des als Sicherheit zu empfangenden Vermögenswerts nach Anwendung des zugehörigen LCR Haircut (wenn der Vermögenswert als liquides Aktivum anerkannt wird) größer ist als der zu verleihende Geldbetrag, wird die Differenz in {C 74.00; r0260} („Andere Zuflüsse“) als Zufluss gemeldet. Bei Sicherheitenwaps, bei denen der Nettoeffekt des anfänglichen Tausches von Vermögenswerten (unter Berücksichtigung von LCR Haircuts) zu einem Zufluss führt, wird ein solcher Zufluss in {C 74.00; r0260} („Andere Zuflüsse“) gemeldet.
21. Forward-Repo-Geschäfte, Forward-Reverse-Repo-Geschäfte und Forward-Sicherheitenwaps, die nicht innerhalb der für die LCR maßgeblichen 30 Tage-Frist beginnen und fällig werden, wirken sich nicht auf die LCR einer Bank aus und können ignoriert werden.
- 1.4. Entscheidungsbaum für LCR-Zuflüsse gemäß Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61
 22. Der Entscheidungsbaum gilt vorbehaltlich der Meldung der Zusatzinformationen. Der Entscheidungsbaum ist Teil der Erläuterungen zur Festlegung der Kriterien für die Bewertung der Prioritätensetzung für die einzelnen gemeldeten Posten, um einheitliche und vergleichbare Meldungen sicherzustellen. Das Abarbeiten des Entscheidungsbaums allein reicht jedoch nicht aus. Die Kreditinstitute müssen stets auch die übrigen Erläuterungen in Betracht ziehen.
 23. Zur Vereinfachung werden bei dem Entscheidungsbaum Summen und Zwischensummen ignoriert, was jedoch nicht bedeutet, dass sie nicht ebenfalls ausgewiesen werden müssen.
- 1.4.1. Entscheidungsbaum für die Zeilen des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV

| Nr. | Posten | Entscheidung | Meldung |
|-----|--------|--------------|---------|
|-----|--------|--------------|---------|

| | | | |
|---|--|------|-----------------------|
| 1 | <p>Zufluss, der die operativen Kriterien gemäß Art. 32 erfüllt, wie z. B.:</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> Risikoposition ist nicht überfällig (Art. 32 Abs. 1) <input type="checkbox"/> Das Kreditinstitut hat keinen Grund zu der Annahme, dass sie innerhalb von 30 Kalendertagen nicht erfüllt werden (Art. 32 Abs. 1) <input type="checkbox"/> Die Kreditinstitute berücksichtigen keine Zuflüsse aus neu eingegangenen Verpflichtungen (Art. 32 Abs. 7) <input type="checkbox"/> Zuflüsse, die bereits gegen Abflüsse aufgerechnet wurden, werden nicht gemeldet (Art. 26) <input type="checkbox"/> Die Kreditinstitute berücksichtigen keine Zuflüsse aus liquiden Aktiva im Sinne des Titels II, ausgenommen fällige Zahlungen auf Aktiva, die nicht im Marktwert des Vermögenswerts berücksichtigt sind (Art. 32 Abs. 6) | Nein | Keine Meldung |
| | | Ja | Nr. 2 |
| 2 | Forward-Geschäft | Ja | Nr. 3 |
| | | Nein | Nr. 5 |
| 3 | Forward-Geschäft, das nach dem Meldestichtag abgeschlossen wurde | Ja | Keine Meldung |
| | | Nein | Nr. 4 |
| 4 | Forward-Geschäfte, die innerhalb der 30-Tage-Frist beginnen und deren Fälligkeit außerhalb dieser 30 Tage-Frist liegt, sofern die anfängliche Komponente zu einem Netto-Zufluss führt. | Ja | Zeile 260, ID 1.1.11. |
| | | Nein | Keine Meldung |
| 5 | Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems | Ja | Nr. 6 |
| | | Nein | Nr. 7 |
| 6 | Zuflüsse aus nicht in Anspruch genommenen Kredit- bzw. Liquiditätsfazilitäten, die durch Mitglieder einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems bereitgestellt wurden, wobei die zuständige Behörde die Anwendung einer günstigeren Zuflussrate genehmigt hat (Art. 34) | Ja | Zeile 250, ID 1.1.10. |
| | | Nein | Nr. 7 |
| 7 | Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit Ausnahme von Derivaten (Art. 32 Abs. 3 Buchst. b–c und e–f) | Ja | Nr. 23 |
| | | Nein | Nr. 8 |
| 8 | Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden (Art. 32 Abs. 2 Buchst. c) | Ja | Zeile 190, ID 1.1.5. |
| | | Nein | Nr. 9 |
| 9 | Fällige Zahlungen aus Handelsfinanzierungen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen (Art. 32 Abs. 2 Buchst. b) | Ja | Zeile 180, ID 1.1.4. |
| | | Nein | Nr. 10 |

| | | | | | |
|----|--|--------------|---|------------------------|--------------------------|
| 10 | Darlehen mit unbestimmtem vertraglichem Endtermin (Art. 32 Abs. 3 Ziffer i) | | Ja | Nr. 11 | |
| | | | Nein | Nr. 12 | |
| 11 | Zins- und Mindestzahlungen aus Darlehen mit unbestimmtem vertraglichem Endtermin, die vertraglich fällig sind und innerhalb der nächsten 30 Kalendertage einem tatsächlichen Zufluss unterliegen | | Ja | Nr. 12 | |
| | | | Nein | Zeile 201, ID 1.1.6. | |
| 12 | Fällige Zahlungen aus Positionen in Eigenkapitalinstrumenten eines wichtigen Indexes, sofern sie nicht gleichzeitig als liquide Aktiva erfasst werden (Art. 32 Abs. 2 Buchst. d) | | Ja | Zeile 210, ID 1.1.7. | |
| | | | Nein | Nr. 13 | |
| 13 | Zuflüsse aus der Freigabe von Salden, die im Einklang mit Vorschriften für die Sicherung von Kundenhandelsaktiva auf getrennten Konten geführt werden (Art. 32 Abs. 4) | | Ja | Zeile 230, ID 1.1.8. | |
| | | | Nein | Nr. 14 | |
| 14 | Mittelzuflüsse aus Derivaten auf Nettobasis nach Gegenpartei und Sicherheit (Art. 32 Abs. 5) | | Ja | Zeile 240, ID 1.1.9. | |
| | | | Nein | Nr. 15 | |
| 15 | Zuflüsse in Verbindung mit Abflüssen im Einklang mit Förderdarlehenszusagen gemäß Art. 31 Abs. 9 (Art. 32 Abs. 3 Buchst. a) | | Ja | Zeile 170, ID 1.1.3. | |
| | | | Nein | Nr. 16 | |
| 16 | Fällige Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen (Art. 32 Abs. 2 Buchst. a) | | Ja | Nr. 20 | |
| | | | Nein | Nr. 17 | |
| 17 | Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken), die keiner Kapitalrückzahlung entsprechen (Art. 32 Abs. 2) | | Ja | Zeile 040, ID 1.1.1.1. | |
| | | | Nein | Nr. 18 | |
| 18 | Andere fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken) (Art. 32 Abs. 3 Buchst. a) | | Ja | Nr. 19 | |
| | | | Nein | Zeile 260, ID 1.1.11. | |
| 19 | Andere fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken) (Art. 32 Abs. 3 Buchst. a) | Nr. 1 9.1 | Privatkunden | Ja | Zeile 060, ID 1.1.1.2.1. |
| | | | | Nein | Nr. 19.2 |
| | | Nr. 1 9.2 | Nichtfinanzunternehmen | Ja | Zeile 070, ID 1.1.1.2.2. |
| | | | | Nein | Nr. 19.3 |
| | | Nr. 1 9.3 | Staaten, multilaterale Entwicklungsbanken und öffentliche Stellen | Ja | Zeile 080, ID 1.1.1.2.3. |
| | | | | Nein | Zeile 090, ID 1.1.1.2.4. |
| 20 | | | Ja | Nr. 21 | |

| | | | | | |
|----|---|-----------|---|--------------------------------|---|
| | Zuflüsse von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind (Art. 32 Abs. 3 Buchst. d) | | Nein | Nr. 22 | |
| 21 | Das Kreditinstitut kann eine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln (Art. 32 Abs. 3 Buchst. d) | | Ja | Zeile 120, ID 1.1.2.1.1. | |
| | | | Nein | Zeile 130, ID 1.1.2.1.2. | |
| 22 | Fällige Zahlungen von Zentralbanken (Art. 32 Abs. 2 Buchst. a) | | Ja | Zeile 150, ID 1.1.2.2.1. | |
| | | | Nein | Zeile 160, ID 1.1.2.2.2. | |
| 23 | Sicherheitswap (Art. 32 Abs. 3 Buchst. e) | | Ja | Zeile 410, ID 1.3 ² | |
| | | | Nein | Nr. 24 | |
| 24 | Geschäft mit einer Zentralbank | | Ja | Nr. 25 | |
| | | | Nein | Nr. 31 | |
| 25 | Sicherheiten, die generell als liquide Aktiva anerkannt werden können (unabhängig davon, ob sie bei einem weiteren Geschäft wiederverwendet werden und unabhängig davon, ob sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 erfüllen) | | Ja | Nr. 26 | |
| | | | Nein | Nr. 30 | |
| 26 | Sicherheiten zur Deckung von Leerverkaufspositionen | | Ja | Zeile 297, ID 1.2.1.2 | |
| | | | Nein | Nr. 27 | |
| 27 | Die erhaltene Sicherheit erfüllt die operativen Anforderungen des Artikels 8 | | Ja | Nr. 28 | |
| | | | Nein | Nr. 29 | |
| 28 | Besicherte Finanzierungsgeschäfte (Art. 32 Abs. 3 Buchst. b): | Nr. 2 8.1 | Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität | Ja | Zeile 269, ID 1.2.1.1.1 + Zeile 271, ID 1.2.1.1.1.1 |
| | | | Nein | Nr. 28.2 | |
| | | Nr. 2 8.2 | Sicherheiten der Stufe 1 in Form gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität | Ja | Zeile 273, ID 1.2.1.1.2 + Zeile 275, ID 1.2.1.1.2.1 |
| | | | | Nein | Nr. 28.3 |
| | | Nr. 2 8.3 | Sicherheiten der Stufe 2A | Ja | Zeile 277, ID 1.2.1.1.3 + Zeile 279, |
| | | | | | |

²Sicherheitswaps müssen zusätzlich im Meldebogen C 75.01 in ANHANG XXIV gemeldet werden.

| | | | | | |
|----|---|--------------|--|------|--|
| | | | | | ID 1.2.1.1.3.1 |
| | | | | Nein | Nr. 28.4 |
| | | Nr. 2 8.4 | Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz) | Ja | Zeile 281, ID 1.2.1.1.4 + Zeile 283, ID 1.2.1.1.4.1 |
| | | | | Nein | Nr. 28.5 |
| | | Nr. 2 8.5 | Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B | Ja | Zeile 285, ID 1.2.1.1.5 + Zeile 287, ID 1.2.1.1.5.1 |
| | | | | Nein | Nr. 28.6 |
| | | Nr. 2 8.6 | Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen) | Ja | Zeile 289, ID 1.2.1.1.6 + Zeile 291, ID 1.2.1.1.6.1 |
| | | | | Nein | Zeile 293, ID 1.2.1.1.7 + Zeile 295, ID 1.2.1.1.7.1 |
| 29 | Besicherte Finanzierungsgeschäfte (Art. 32 Abs. 3 Buchst. b): | Nr. 2 9.1 | Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität | Ja | Zeile 269, ID 1.2.1.1.1 |
| | | | | Nein | Nr. 29.2 |
| | | Nr. 2 9.2 | Sicherheiten der Stufe 1 in Form gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität | Ja | Zeile 273, ID 1.2.1.1.2 |
| | | | | Nein | Nr. 29.3 |
| | | Nr. 2 9.3 | Sicherheiten der Stufe 2A | Ja | Zeile 277, ID 1.2.1.1.3 |
| | | | | Nein | Nr. 29.4 |
| | | Nr. 2 9.4 | Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B | Ja | Zeile 281, ID 1.2.1.1.4 |
| | | | | Nein | Nr. 29.5 |

| | | | | | |
|--------------|---|--------------|--|------|--|
| | | | (Wohnimmobilien oder Kfz) | | |
| | | Nr. 2 9.5 | Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B | Ja | Zeile 285, ID 1.2.1.1.5 |
| | | | | Nein | Nr. 29.6 |
| | | Nr. 2 9.6 | Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen) | Ja | Zeile 289, ID 1.2.1.1.6 |
| | | | | Nein | Zeile 293, ID 1.2.1.1.7 |
| 30 | Sicherheiten, die nicht als liquide Aktiva anerkannt werden (Art. 32 Abs. 3 Buchst. b) und nicht liquide Eigenmittel sind | | | Ja | Zeile 301, ID 1.2.1.3.1 |
| | | | | Nein | Zeile 303, ID 1.2.1.3.2 |
| 31 | Sicherheiten, die generell als liquide Aktiva anerkannt werden können (unabhängig davon, ob sie bei einem weiteren Geschäft wiederverwendet werden und unabhängig davon, ob sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 erfüllen) | | | Ja | Nr. 32 |
| | | | | Nein | Nr. 36 |
| 32 | Sicherheiten zur Deckung von Leerverkaufspositionen | | | Ja | Zeile 337, ID 1.2.2.2 |
| | | | | Nein | Nr. 33 |
| 33 | Die erhaltene Sicherheit erfüllt die operativen Anforderungen des Artikels 8 | | | Ja | Nr. 34 |
| | | | | Nein | Nr. 35 |
| 34 | Besicherte Finanzierungsgeschäfte (Art. 32 Abs. 3 Buchst. b) | Nr. 3 4.1 | Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität | Ja | Zeile 309, ID 1.2.2.1.1 + Zeile 311, ID 1.2.2.1.1.1 |
| | | | | Nein | Nr. 34.2 |
| | | Nr. 3 4.2 | Sicherheiten der Stufe 1 in Form gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität | Ja | Zeile 313, ID 1.2.2.1.2 + Zeile 315, ID 1.2.2.1.2.1 |
| | | | | Nein | Nr. 34.3 |
| Nr. 3 4.3 | Sicherheiten der Stufe 2A | Ja | Zeile 317, ID 1.2.2.1.3 + | | |

| | | | | | | |
|--------------|------|--------------|--|----------------------------|--|----------------------------|
| | | | | | Zeile 319, ID 1.2.2.1.3.1 | |
| | | | | Nein | Nr. 34.4 | |
| | | Nr. 3 4.4 | Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz) | Ja | Zeile 321, ID 1.2.2.1.4 + Zeile 323, ID 1.2.2.1.4.1 | |
| | | | | Nein | Nr. 34.5 | |
| | | Nr. 3 4.5 | Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B | Ja | Zeile 325, ID 1.2.2.1.5 + Zeile 327, ID 1.2.2.1.5.1 | |
| | | | | Nein | Nr. 34.6 | |
| | | Nr. 3 4.6 | Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen) | Ja | Zeile 329, ID 1.2.2.1.6 + Zeile 331, ID 1.2.2.1.6.1 | |
| | | | | Nein | Zeile 333, ID 1.2.2.1.7 + Zeile 335, ID 1.2.2.1.7.1 | |
| | | 35 | Besicherte Finanzierungsgeschäfte (Art. 32 Abs. 3 Buchst. b) | Nr. 3 5.1 | Ja | Zeile 309, ID 1.2.2.1.1 |
| | | | | | Nein | Nr. 35.2 |
| Nr. 3 5.2 | Ja | | | Zeile 313, ID 1.2.2.1.2 | | |
| | Nein | | | Nr. 35.3 | | |
| Nr. 3 5.3 | Ja | | | Zeile 317, ID 1.2.2.1.3 | | |
| | Nein | | | Nr. 35.4 | | |
| Nr. 3 5.4 | Ja | | | Zeile 321, ID 1.2.2.1.4 | | |
| | Nein | | | Nr. 35.5 | | |

| | | | | | |
|----|--|--------------|--|------|-----------------------------|
| | | | (Wohnimmobilien oder Kfz) | | |
| | | Nr. 3 5.5 | Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B | Ja | Zeile 325, ID 1.2.2.1.5 |
| | | | | Nein | Nr. 35.6 |
| | | Nr. 3 5.6 | Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen) | Ja | Zeile 329, ID 1.2.2.1.6 |
| | | | | Nein | Zeile 333, ID 1.2.2.1.7 |
| 36 | Sicherheiten, die nicht als liquide Aktiva anerkannt werden (Art. 32 Abs. 3 Buchst. b) | Nr. 3 6.1 | Lombardgeschäfte: Sicherheiten sind nicht liquide | Ja | Zeile 341, ID 1.2.2.3.1. |
| | | | | Nein | Nr. 36.2 |
| | | Nr. 3 6.2 | Sicherheiten sind nicht liquide Eigenmittel | Ja | Zeile 343, ID 1.2.2.3.2. |
| | | | | Nein | Zeile 345, ID 1.2.2.3.3. |

1.4.2. Entscheidungsbaum für die Spalten des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV

| Nr. | Posten | Entscheidung | Meldung | |
|-----|---|--------------|--|-------|
| 1 | Zufluss, der in den Zeilen 0010-0430 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV gemäß Art. 32, Art. 33 und Art. 34 sowie entsprechend der Klassifizierung in Abschnitt 1 („Entscheidungsbaum für die Zeilen des Meldebogens C 74.00“) zu melden ist | Nein | Keine Meldung | |
| | | Ja | Nr. 2 | |
| 2 | Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit Ausnahme von Derivaten (Art. 32 Abs. 3 Buchst. b–c und e–f) | Ja | Nr. 11 | |
| | | Nein | Nr. 3 | |
| 3 | Teilweiser Ausschluss von der Obergrenze für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 2–5) | Ja | Nr. 4 | |
| | | Nein | Nr. 6 | |
| 4 | Teilweiser Ausschluss von der Obergrenze für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 2–5) | Nr. 4.1 | Teil der Zuflüsse, der von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen ist | Nr. 5 |

| | | | | | |
|----|---|----------|--|------|-------------|
| | | Nr. 4.2 | Teil der Zuflüsse, der nicht von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen ist | | Nr. 7 |
| 5 | Teil der Zuflüsse, der von der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse vorbehaltlich der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse ausgenommen ist (Art. 33 Abs. 4 und 5) | | | Ja | Nr. 9 |
| | | | | Nein | Nr. 10 |
| 6 | Zufluss mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 1) | | | Ja | Nr. 7 |
| | | | | Nein | Nr. 8 |
| 7 | Zufluss mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 1) | Nr. 7.1 | Fällige Zahlungen/Höchstbetrag, der in Anspruch genommen werden kann | | Spalte 0010 |
| | | Nr. 7.2 | Anwendbare Gewichtung | | Spalte 0080 |
| | | Nr. 7.3 | Zufluss | | Spalte 0140 |
| 8 | Zufluss mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 4 und 5) | | | Ja | Nr. 9 |
| | | | | Nein | Nr. 10 |
| 9 | Zufluss mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 4 und 5) | Nr. 9.1 | Fällige Zahlungen/Höchstbetrag, der in Anspruch genommen werden kann | | Spalte 0020 |
| | | Nr. 9.2 | Anwendbare Gewichtung | | Spalte 0090 |
| | | Nr. 9.3 | Zufluss | | Spalte 0150 |
| 10 | Zuflüsse, die vollständig von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen sind (Art. 33 Abs. 2–3) | Nr. 10.1 | Fällige Zahlungen/Höchstbetrag, der in Anspruch genommen werden kann | | Spalte 0030 |
| | | Nr. 10.2 | Anwendbare Gewichtung | | Spalte 0100 |
| | | Nr. 10.3 | Zufluss | | Spalte 0160 |
| 11 | Besicherte Finanzierungsgeschäfte, wobei die Sicherheiten generell als liquide Aktiva anerkannt werden können (unabhängig davon, ob sie bei einem | | | Ja | Nr. 12 |
| | | | | Nein | Nr. 3 |

| | | | | |
|----|---|----------|--|--------|
| | weiteren Geschäft wiederverwendet werden und unabhängig davon, ob sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 erfüllen) | | | |
| 12 | Teilweiser Ausschluss von der Obergrenze für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 2–5) | | Ja | Nr. 13 |
| | | | Nein | Nr. 15 |
| 13 | Teilweiser Ausschluss von der Obergrenze für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 2–5) | Nr. 13.1 | Teil der Zuflüsse, der von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen ist | Nr. 14 |
| | | Nr. 13.2 | Teil der Zuflüsse, der nicht von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen ist | Nr. 16 |
| 14 | Teil der Zuflüsse, der von der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse vorbehaltlich der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse ausgenommen ist (Art. 33 Abs. 4 und 5) | | Ja | Nr. 18 |
| | | | Nein | Nr. 19 |

| | | | | |
|----|---|----------|---|-------------|
| 15 | Zufluss mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 1) | | Ja | Nr. 16 |
| | | | Nein | Nr. 17 |
| 16 | Zufluss mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 1) | Nr. 16.1 | Fällige Zahlungen | Spalte 0010 |
| | | Nr. 16.2 | Marktwert der empfangenen Sicherheiten | Spalte 0040 |
| | | Nr. 16.3 | Anwendbare Gewichtung | Spalte 0080 |
| | | Nr. 16.4 | Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9 [nur wenn die erhaltene Sicherheit die operativen Anforderungen erfüllt] | Spalte 0110 |

| | | | | | |
|----|---|----------|---|------|-------------|
| | | | | | |
| | | Nr. 16.5 | Zufluss | | Spalte 0140 |
| 17 | Zufluss mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 4 und 5) | | | Ja | Nr. 18 |
| | | | | Nein | Nr. 19 |
| 18 | Zufluss mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse (Art. 33 Abs. 4 und 5) | Nr. 18.1 | Fällige Zahlungen | | Spalte 0020 |
| | | Nr. 18.2 | Marktwert der empfangenen Sicherheiten | | Spalte 0050 |
| | | Nr. 18.3 | Anwendbare Gewichtung | | Spalte 0090 |
| | | Nr. 18.4 | Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9 [nur wenn die erhaltene Sicherheit die operativen Anforderungen erfüllt] | | Spalte 0120 |
| | | Nr. 18.5 | Zufluss | | Spalte 0150 |
| 19 | Zuflüsse, die vollständig von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen sind (Art. 33 Abs. 2–3) | Nr. 19.1 | Fällige Zahlungen | | Spalte 0030 |
| | | Nr. 19.2 | Marktwert der empfangenen Sicherheiten | | Spalte 0060 |
| | | Nr. 19.3 | Anwendbare Gewichtung | | Spalte 0100 |
| | | Nr. 19.4 | Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9 [nur wenn die erhaltene Sicherheit die operativen Anforderungen erfüllt] | | Spalte 0130 |

| | | | | | |
|--|--|----------|---------|--|-------------|
| | | | | | |
| | | Nr. 19.5 | Zufluss | | Spalte 0160 |

1.5. Einzelbogen Zuflüsse

1.5.1. Erläuterungen zu bestimmten Spalten

| Spalte | Rechtsgrundlagen und Erläuterungen |
|--------|--|
| 0010 | <p>Betrag — Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269-0297, 0301-0303, 0309-0337, 0341-0345, 0450 und 0470-0510 melden die Kreditinstitute in Spalte 0010 den Gesamtbetrag der Vermögenswerte/fälligen Zahlungen/Höchstbeträge, die in Anspruch genommen werden können, die der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen, wobei die hierin enthaltenen einschlägigen Erläuterungen beachtet werden.</p> <p>Wenn eine zuständige Behörde eine teilweise Ausnahme von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt hat, wird der Teil des Betrags, für den die Ausnahme gilt, in Spalte 0020 oder 0030 und der Teil des Betrags, für den die Ausnahme nicht gilt, in Spalte 0010 ausgewiesen.</p> |
| 0020 | <p>Betrag — Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269-0297, 0301-0303, 0309-0337, 0341-0345, 0450 und 0470-0510 melden die Kreditinstitute in Spalte 0020 den Gesamtbetrag der Vermögenswerte/fälligen Zahlungen/Höchstbeträge, die in Anspruch genommen werden können, die der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absätze 4 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen, wobei die hierin enthaltenen einschlägigen Erläuterungen beachtet werden.</p> <p>Wenn eine zuständige Behörde eine teilweise Ausnahme von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt hat, wird der Teil des Betrags, für den die Ausnahme gilt, in Spalte 0020 oder 0030 und der Teil des Betrags, für den die Ausnahme nicht gilt, in Spalte 0010 ausgewiesen.</p> |
| 0030 | <p>Betrag – Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269-0297, 0301-0303, 0309-0337, 0341-0345, 0450 und 0470-0510 melden die Kreditinstitute in Spalte 0030 den Gesamtbetrag der Vermögenswerte/fälligen Zahlungen/Höchstbeträge, die in Anspruch genommen werden können, die in voller Höhe von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absätze 2, 3 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ausgenommen sind, wobei die hierin enthaltenen einschlägigen Erläuterungen beachtet werden.</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Wenn eine zuständige Behörde eine teilweise Ausnahme von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt hat, wird der Teil des Betrags, für den die Ausnahme gilt, in Spalte 0020 oder 0030 und der Teil des Betrags, für den die Ausnahme nicht gilt, in Spalte 0010 ausgewiesen.</p> |
| 0040 | <p>Marktwert der empfangenen Sicherheiten — Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0269-0295, 0309-0335 und für Zeile 0490 melden die Kreditinstitute in Spalte 0040 den Marktwert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, die der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen.</p> <p>Wenn eine zuständige Behörde eine teilweise Ausnahme von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt hat, wird der Marktwert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, für den die Ausnahme gilt, in Spalte 0050 oder 0060 und der Marktwert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, für den die Ausnahme nicht gilt, in Spalte 0040 ausgewiesen.</p> |
| 0050 | <p>Marktwert der empfangenen Sicherheiten — Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0269-0295, 0309-0335 und für Zeile 0490 melden die Kreditinstitute in Spalte 0050 den Marktwert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, die der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absätze 4 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen.</p> <p>Wenn eine zuständige Behörde eine teilweise Ausnahme von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt hat, wird der Marktwert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, für den die Ausnahme gilt, in Spalte 0050 oder 0060 und der Marktwert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, für den die Ausnahme nicht gilt, in Spalte 0040 ausgewiesen.</p> |
| 0060 | <p>Marktwert der empfangenen Sicherheiten — Von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0269-0295, 0309-0335 und für Zeile 0490 melden die Kreditinstitute in Spalte 0060 den Marktwert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, die vollständig von der Obergrenze für</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absätze 2, 3 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ausgenommen sind.</p> <p>Wenn eine zuständige Behörde eine teilweise Ausnahme von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt hat, wird der Marktwert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, für den die Ausnahme gilt, in Spalte 0050 oder 0060 und der Marktwert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, für den die Ausnahme nicht gilt, in Spalte 0040 ausgewiesen.</p> |
| 0070 | <p>Standardgewichtung</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Standardgewichtungen in Spalte 0070 entsprechen denjenigen, die in der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 standardmäßig angegeben sind, und werden hier nur zur Information bereitgestellt.</p> |
| 0080 | <p>Anwendbare Gewichtung — Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Diese anwendbare Gewichtung entspricht derjenigen, die in den Artikeln 32 bis 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 angegeben ist. Anwendbare Gewichtungen können zu gewichteten Durchschnittswerten führen und werden im Dezimalformat gemeldet (z. B. 1,00 für eine anwendbare Gewichtung von 100 Prozent oder 0,50 für eine anwendbare Gewichtung von 50 Prozent). Anwendbare Gewichtungen können u. a. unternehmensspezifische und nationale Ermessensspielräume widerspiegeln.</p> <p>Für die Zeilen 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 und 0470-0510 melden die Kreditinstitute in Spalte 0080 den die durchschnittliche Gewichtung, die sie auf die Vermögenswerte/fälligen Zahlungen/Höchstbeträge, die in Anspruch genommen werden können, angewandt haben, die der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen.</p> |
| 0090 | <p>Anwendbare Gewichtung — Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Diese anwendbaren Gewichtungen entsprechen denjenigen, die in den Artikeln 32 bis 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 angegeben sind. Anwendbare Gewichtungen können zu gewichteten Durchschnittswerten führen und werden im Dezimalformat gemeldet (z. B. 1,00 für eine anwendbare Gewichtung von 100 Prozent oder 0,50 für eine anwendbare Gewichtung von 50 Prozent). Anwendbare Gewichtungen können u. a. unternehmensspezifische und nationale Ermessensspielräume widerspiegeln.</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Für die Zeilen 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 und 0470-0510 melden die Kreditinstitute in Spalte 0090 den die durchschnittliche Gewichtung, die sie auf die Vermögenswerte/fälligen Zahlungen/Höchstbeträge, die in Anspruch genommen werden können, angewandt haben, die der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absätze 4 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen.</p> |
| 0100 | <p>Anwendbare Gewichtung — von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Diese anwendbaren Gewichtungen entsprechen denjenigen, die in den Artikeln 32 bis 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 angegeben sind. Anwendbare Gewichtungen können zu gewichteten Durchschnittswerten führen und werden im Dezimalformat gemeldet (z. B. 1,00 für eine anwendbare Gewichtung von 100 Prozent oder 0,50 für eine anwendbare Gewichtung von 50 Prozent). Anwendbare Gewichtungen können u. a. unternehmensspezifische und nationale Ermessensspielräume widerspiegeln.</p> <p>Für die Zeilen 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 und 0470-0510 melden die Kreditinstitute in Spalte 0100 den die durchschnittliche Gewichtung, die sie auf die Vermögenswerte/fälligen Zahlungen/Höchstbeträge, die in Anspruch genommen werden können, angewandt haben, die von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absätze 2, 3 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ausgenommen sind.</p> |
| 0110 | <p>Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9 — Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0271, 0275, 0279, 0283, 0287, 0291, 0295, 0311, 0315, 0319, 0323, 0327, 0331 und 0335 melden die Kreditinstitute in Spalte 0110 den Wert der gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, die der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen.</p> <p>Wenn eine zuständige Behörde eine teilweise Ausnahme von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt hat, wird der Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, für den die Ausnahme gilt, in Spalte 0120 oder 0130 und der Wert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, für den die Ausnahme nicht gilt, in Spalte 0110 ausgewiesen.</p> |

| | |
|------|---|
| 0120 | <p>Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9 — Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0271, 0275, 0279, 0283, 0287, 0291, 0295, 0311, 0315, 0319, 0323, 0327, 0331 und 0335 melden die Kreditinstitute in Spalte 0120 den Wert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, die der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absätze 4 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen.</p> <p>Wenn eine zuständige Behörde eine teilweise Ausnahme von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt hat, wird der Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, für den die Ausnahme gilt, in Spalte 0120 oder 0130 und der Wert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, für den die Ausnahme nicht gilt, in Spalte 0110 ausgewiesen.</p> |
| 0130 | <p>Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9 — von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0271, 0275, 0279, 0283, 0287, 0291, 0295, 0311, 0315, 0319, 0323, 0327, 0331 und 0335 melden die Kreditinstitute in Spalte 0130 den Wert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, die gemäß Artikel 33 Absätze 2, 3 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 vollständig von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen sind.</p> <p>Wenn eine zuständige Behörde eine teilweise Ausnahme von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt hat, wird der Wert der empfangenen Sicherheiten gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, für den die Ausnahme gilt, in Spalte 0120 oder 0130 und der Wert der empfangenen Sicherheiten bei besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, für den die Ausnahme nicht gilt, in Spalte 0110 ausgewiesen.</p> |
| 0140 | <p>Zufluss — Mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 und 0470-510 melden die Kreditinstitute in Spalte 0140 die Gesamtzuflüsse, die der Obergrenze von 75 % für</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen, wobei die Gesamtzuflüsse durch Multiplikation des Gesamtbetrags/Höchstbetrags, der in Anspruch genommen werden kann, aus Spalte 0010 mit der relevanten Gewichtung aus Spalte 0080 berechnet werden.</p> <p>Für die Zeile 0170 melden die Kreditinstitute in Spalte 0140 die Gesamtzuflüsse, die der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen, nur, wenn das Kreditinstitut diese Zusage erhalten hat, um Förderdarlehen an Endbegünstigte auszuzahlen, oder eine vergleichbare Zusage von einer multilateralen Entwicklungsbank oder einer öffentlichen Stelle erhalten hat.</p> |
| 0150 | <p>Zufluss — Mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 und 0470-0510 melden die Kreditinstitute in Spalte 0150 die Gesamtzuflüsse, die der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absätze 4 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen, wobei die Gesamtzuflüsse durch Multiplikation des Gesamtbetrags/Höchstbetrags, der in Anspruch genommen werden kann, aus Spalte 0020 mit der relevanten Gewichtung aus Spalte 0090 berechnet werden. Für die Zeile 0170 melden die Kreditinstitute in Spalte 0150 die Gesamtzuflüsse, die der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absätze 4 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 unterliegen, nur, wenn das Kreditinstitut diese Zusage erhalten hat, um Förderdarlehen an Endbegünstigte auszuzahlen, oder eine vergleichbare Zusage von einer multilateralen Entwicklungsbank oder einer öffentlichen Stelle erhalten hat.</p> |
| 0160 | <p>Zufluss — von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Für die Zeilen 0040, 0060-0090, 0120-0130, 0150-0260, 0269, 0273, 0277, 0281, 0285, 0289, 0293, 0301-0303, 0309, 0313, 0317, 0321, 0325, 0329, 0333, 0341-0345, 0450 und 0470-0510 melden die Kreditinstitute in Spalte 0160 die Gesamtzuflüsse, die vollständig von der in Artikel 33 Absätze 2, 3 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 festgelegten Obergrenze ausgenommen sind, wobei die Gesamtzuflüsse durch Multiplikation des Gesamtbetrags/Höchstbetrags, der in Anspruch genommen werden kann, aus Spalte 0030 mit der relevanten Gewichtung aus Spalte 0100 berechnet werden.</p> <p>Für die Zeile 0170 melden die Kreditinstitute in Spalte 0160 die Gesamtzuflüsse, die vollständig von der Obergrenze für Zuflüsse gemäß Artikel 33 Absatz 2, 3 und 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 ausgenommen sind, nur, wenn das Kreditinstitut diese Zusage erhalten hat, um Förderdarlehen an Endbegünstigte auszuzahlen, oder eine vergleichbare Zusage von einer multilateralen Entwicklungsbank oder einer öffentlichen Stelle erhalten hat.</p> |

1.5.2. Erläuterungen zu bestimmten Zeilen

| Zeile | Rechtsgrundlagen und Erläuterungen |
|-------|---|
| 0010 | <p>1. ZUFLÜSSE INSGESAMT</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0010 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 jeweils den Gesamtbetrag der Vermögenswerte/fälligen Zahlungen/Höchstbeträge, die in Anspruch genommen werden können, aus unbesicherten Geschäften/Einlagen und besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen; <input type="checkbox"/> für die Spalte 0140 die Summe der Zuflüsse aus unbesicherten Geschäften/Einlagen, besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen und Sicherheitenwaps abzüglich der Differenz zwischen der Summe der gewichteten Zuflüsse und der Summe der gewichteten Abflüsse aus Drittländern, in denen Transferbeschränkungen gelten oder die auf nichtkonvertierbare Währungen lauten; und <input type="checkbox"/> für die Spalten 0150 und 0160 die Summe der Zuflüsse aus unbesicherten Geschäften/Einlagen, besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen und Sicherheitenwaps abzüglich der Differenz zwischen der Summe der gewichteten Zuflüsse und der Summe der gewichteten Abflüsse aus Drittländern, in denen Transferbeschränkungen gelten oder die auf nichtkonvertierbare Währungen lauten, sowie abzüglich der überschüssigen Zuflüsse von einem verbundenen spezialisierten Kreditinstitut gemäß Artikel 2 Absatz 3 Buchstabe e und Artikel 33 Absatz 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. |
| 0020 | <p>1.1. Zuflüsse aus unbesicherten Geschäften/Einlagen</p> <p>Artikel 32, 33 und 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0020 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 jeweils den Gesamtbetrag der Vermögenswerte/fälligen Zahlungen/Höchstbeträge, die in Anspruch genommen werden können, aus unbesicherten Geschäften/Einlagen; und <input type="checkbox"/> für die Spalten 0140, 0150 und 0160 jeweils die Summe der Zuflüsse aus unbesicherten Geschäften/Einlagen. |
| 0030 | <p>1.1.1. Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken)</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0030 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 jeweils den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen |

| | |
|------|---|
| | <p>Zentralbanken) (fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden, die keiner Kapitalrückzahlung entsprechen, sowie andere fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden) und</p> <ul style="list-style-type: none"> □ für die Spalten 0140, 0150 und 0160 jeweils die Summe der Zuflüsse von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken) (Zuflüsse von Nichtfinanzkunden, die keiner Kapitalrückzahlung entsprechen, sowie andere Zuflüsse von Nichtfinanzkunden). <p>Gemäß Artikel 31a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 umfassen Nichtfinanzkunden unter anderem, aber nicht ausschließlich, natürliche Personen, KMU, Unternehmen, Staaten, multilaterale Entwicklungsbanken und öffentliche Stellen.</p> <p>Fällige Zahlungen aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit Nichtfinanzkunden, die durch liquide Aktiva gemäß Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 besichert sind, wobei diese Transaktionen in Artikel 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 festgelegt sind, werden in Abschnitt 1.2. und nicht in Abschnitt 1.1.1. gemeldet. Fällige Zahlungen aus solchen Transaktionen, die durch übertragbare Wertpapiere, die nicht als liquide Aktiva gemäß Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gelten, besichert sind, werden in Abschnitt 1.2. und nicht in Abschnitt 1.1.1. gemeldet. Fällige Zahlungen aus solchen Transaktionen mit Nichtfinanzkunden, die durch nicht übertragbare Wertpapiere, die nicht als liquide Aktiva gemäß Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gelten, besichert sind, werden in der entsprechenden Zeile des Abschnitts 1.1.1. gemeldet.</p> <p>Fällige Zahlungen von Zentralbanken werden in Abschnitt 1.1.2. und nicht hier ausgewiesen. Fällige Zahlungen aus Handelsfinanzierungen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen werden nicht hier, sondern in Abschnitt 1.1.4 gemeldet. Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, werden nicht hier, sondern in Abschnitt 1.1.5. gemeldet.</p> |
| 0040 | <p>1.1.1.1. Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken), die keiner Kapitalrückzahlung entsprechen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken) mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, die keiner Kapitalrückzahlung entsprechen. Diese Zuflüsse umfassen fällige Zinsen und Gebühren von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken). Fällige Zahlungen von Zentralbanken, die keiner Kapitalrückzahlung entsprechen, werden nicht hier, sondern in Abschnitt 1.1.2. ausgewiesen.</p> |
| 0050 | <p>1.1.1.2. Andere fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken)</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0050 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> □ für die Spalten 0010, 0020 und 0030 jeweils den Gesamtbetrag der anderen fälligen Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen |

| | |
|------|--|
| | <p>Zentralbanken) als Summe der fälligen Zahlungen von Nichtfinanzkunden nach Gegenpartei und</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0140, 0150 und 0160 jeweils die Summe der anderen Zuflüsse von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken) als Summe der anderen Zuflüsse von Nichtfinanzkunden nach Gegenpartei. <p>Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken), die keiner Kapitalrückzahlung entsprechen, werden in Abschnitt 1.1.1.1. und nicht hier ausgewiesen.</p> <p>Andere fällige Zahlungen von Zentralbanken werden in Abschnitt 1.1.2. und nicht hier ausgewiesen.</p> <p>Zuflüsse in Verbindung mit Abflüssen im Einklang mit Förderdarlehenszusagen gemäß Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 werden in Abschnitt 1.1.3. und nicht hier gemeldet.</p> |
| 0060 | <p>1.1.1.2.1. Fällige Zahlungen von Privatkunden</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen von Privatkunden mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen.</p> |
| 0070 | <p>1.1.1.2.2. Fällige Zahlungen von Nichtfinanzunternehmen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen von Nichtfinanzunternehmen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen.</p> |
| 0080 | <p>1.1.1.2.3. Fällige Zahlungen von Staaten, multilateralen Entwicklungsbanken und öffentlichen Stellen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen von Staaten, multilateralen Entwicklungsbanken und öffentlichen Stellen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen.</p> |
| 0090 | <p>1.1.1.2.4. Fällige Zahlungen von anderen juristischen Personen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen oben nicht erfassten anderen juristischen Personen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen.</p> |
| 0100 | <p>1.1.2. Fällige Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden</p> <p>Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe a und Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe d in Verbindung mit Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0100 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden (operative und nicht operative Einlagen); und |

| | |
|------|---|
| | <p><input type="checkbox"/> für die Spalten 0140, 0150 und 0160 die Summe der Zuflüsse von Zentralbanken und Finanzkunden (operative und nicht operative Einlagen).</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier fällige Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, die nicht überfällig sind und bei denen die Bank keinen Grund zu der Annahme hat, dass sie innerhalb des 30-tägigen Zeithorizonts nicht erfüllt werden.</p> <p>Fällige Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden, die keiner Kapitalrückzahlung entsprechen, werden im betreffenden Abschnitt gemeldet.</p> <p>Einlagen beim Zentralinstitut gemäß Artikel 27 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 werden nicht als Zufluss gemeldet.</p> <p>Fällige Zahlungen aus Handelsfinanzierungen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen werden nicht hier, sondern in Abschnitt 1.1.4 gemeldet. Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, werden nicht hier, sondern in Abschnitt 1.1.5. gemeldet.</p> |
| 0110 | <p>1.1.2.1. Fällige Zahlungen von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe d in Verbindung mit Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0110 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <p><input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind (ungeachtet davon, ob das Kreditinstitut eine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln kann oder nicht); und</p> <p><input type="checkbox"/> für die Spalten 0140, 0150 und 0160 den Gesamtbetrag der Zuflüsse von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind (ungeachtet davon, ob das Kreditinstitut eine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln kann oder nicht).</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier fällige Zahlungen von Finanzkunden gegenüber dem Kreditinstitut, um Clearing-, Verwahr- oder Gelddispositionsdienstleistungen gemäß Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 in Anspruch zu nehmen.</p> |
| 0120 | <p>1.1.2.1.1. Fällige Zahlungen von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind, wobei das Kreditinstitut eine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln kann</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe d in Verbindung mit Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen von Finanzkunden gegenüber dem Kreditinstitut, um Clearing-, Verwahr- oder Gelddispositionsdienstleistungen gemäß Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 in Anspruch zu nehmen, wobei das Kreditinstitut eine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln kann.</p> |

| | |
|------|--|
| 0130 | <p>1.1.2.1.2. Fällige Zahlungen von Finanzkunden, die als operative Einlagen eingestuft sind, wobei das Kreditinstitut keine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln kann</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe d in Verbindung mit Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen von Finanzkunden gegenüber dem Kreditinstitut, um Clearing-, Verwahr- oder Gelddispositionsdienstleistungen gemäß Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 in Anspruch zu nehmen, wobei das Kreditinstitut keine entsprechende symmetrische Zuflussrate ermitteln kann. Für diese Posten wird eine Zuflussrate von 5 % angewendet.</p> |
| 0140 | <p>1.1.2.2. Fällige Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden, die nicht als operative Einlagen eingestuft sind</p> <p>Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 140 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden, die nicht als operative Einlagen eingestuft sind, und <input type="checkbox"/> für die Spalten 0140, 0150 und 0160 die Summe der Zuflüsse von Zentralbanken und Finanzkunden, die nicht als operative Einlagen eingestuft sind. <p>Die Kreditinstitute melden hier fällige Zahlungen von Zentralbanken und Finanzkunden, die nicht für die Behandlung als operative Einlagen gemäß Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe d in Verbindung mit Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 infrage kommen.</p> |
| 0150 | <p>1.1.2.2.1. Fällige Zahlungen von Zentralbanken</p> <p>Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen von Zentralbanken mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen gemäß Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0160 | <p>1.1.2.2.2. Fällige Zahlungen von Finanzkunden</p> <p>Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen von Finanzkunden, die nicht für die Behandlung als operative Einlagen gemäß Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe d in Verbindung mit Artikel 27 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 infrage kommen.</p> <p>Zuflüsse in Verbindung mit Abflüssen im Einklang mit Förderdarlehenszusagen gemäß Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 werden in Abschnitt 1.1.3. und nicht hier gemeldet.</p> |

| | |
|------|---|
| 0170 | <p>1.1.3. Zuflüsse in Verbindung mit Abflüssen im Einklang mit Förderdarlehenszusagen gemäß Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Zuflüsse in Verbindung mit Abflüssen im Einklang mit Förderdarlehenszusagen gemäß Artikel 31 Absatz 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0180 | <p>1.1.4. Fällige Zahlungen aus Handelsfinanzierungsgeschäften</p> <p>Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen aus Handelsfinanzierungsgeschäften mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen gemäß Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0190 | <p>1.1.5. Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden</p> <p>Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, gemäß Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> |
| 0201 | <p>1.1.6. Darlehen mit unbestimmtem vertraglichem Endtermin</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe i der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Darlehen mit unbestimmtem vertraglichem Endtermin gemäß Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe i der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. Das Kreditinstitut berücksichtigt Zuflüsse nur, sofern es ihm vertraglich möglich ist, zurückzutreten oder eine Zahlung innerhalb von 30 Kalendertagen zu verlangen. Zins- und Mindestzahlungen, die vom Kundenkonto innerhalb von 30 Kalendertagen abgebucht werden können, werden im gemeldeten Betrag erfasst. Zins- und Mindestzahlungen aus Darlehen mit unbestimmtem vertraglichem Endtermin, die vertraglich fällig sind und innerhalb der nächsten 30 Kalendertage einem tatsächlichen Zufluss unterliegen, werden als fällige Zahlungen angesehen und in der betreffenden Zeile entsprechend der in Artikel 32 vorgesehenen Behandlung von fälligen Zahlungen ausgewiesen. Die Kreditinstitute melden keine sonstigen Zinsen, die zwar auflaufen, aber weder vom Kundenkonto abgebucht werden noch innerhalb der nächsten 30 Kalendertage einem tatsächlichen Mittelzufluss unterliegen.</p> |
| 0210 | <p>1.1.7. Fällige Zahlungen aus Positionen in Eigenkapitalinstrumenten eines wichtigen Indexes, sofern sie nicht gleichzeitig als liquide Aktiva erfasst werden</p> <p>Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Fällige Zahlungen aus Positionen in Eigenkapitalinstrumenten eines wichtigen Indexes, sofern sie nicht gleichzeitig als liquide Aktiva gemäß Artikel 32 Absatz 2 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfasst werden. Diese Position umfasst innerhalb der nächsten 30 Kalendertage vertraglich fällige Zahlungen, wie z. B. Bardividenden aus solchen wichtigen Indizes und Barmittel aus solchen</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Eigenkapitalinstrumenten, die verkauft, aber noch nicht abgerechnet sind, sofern sie nicht als liquide Aktiva gemäß Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 anerkannt sind.</p> |
| 0230 | <p>1.1.8. Zuflüsse aus der Freigabe von Salden, die im Einklang mit Vorschriften für die Sicherung von Kundenhandelsaktiva auf getrennten Konten geführt werden</p> <p>Artikel 32 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Zuflüsse aus der Freigabe von Salden, die im Einklang mit Vorschriften für die Sicherung von Kundenhandelsaktiva auf getrennten Konten geführt werden, gemäß Artikel 32 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Die Zuflüsse werden nur berücksichtigt, wenn diese Salden in liquiden Aktiva gemäß Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 gehalten werden.</p> |
| 0240 | <p>1.1.9. Zuflüsse aus Derivaten</p> <p>Artikel 32 Absatz 5 in Verbindung mit Artikel 21 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Der Nettobetrag der innerhalb eines Zeitraums von 30 Kalendertagen erwarteten Forderungen aus den in Anhang II der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 aufgeführten Kontrakten und aus Kreditderivaten.</p> <p>Die Kreditinstitute berechnen die innerhalb von 30 Kalendertagen erwarteten Zuflüsse auf Nettobasis nach Gegenpartei, sofern bilaterale Netting-Vereinbarungen gemäß Artikel 295 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 bestehen. Auf Nettobasis bedeutet hier ferner, dass zu empfangende Sicherheiten, die gemäß Titel II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva anerkannt werden, nicht berücksichtigt werden.</p> <p>Liquiditätsabflüsse und -zuflüsse, die sich aus Fremdwährungs-Derivatgeschäften oder Kreditderivatgeschäften ergeben, die mit einem gleichzeitig (oder am selben Tag) erfolgenden vollständigen Austausch der Kapitalbeträge verbunden sind, werden auf Nettobasis berechnet, auch wenn die jeweiligen Derivatgeschäfte nicht durch eine bilaterale Netting-Vereinbarung gedeckt sind.</p> <p>Im Falle einer gesonderten Meldung nach Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) 575/2013 werden Derivat- oder Kreditderivatgeschäfte in jeder Währung gesondert ausgewiesen. Die Aufrechnung (Netting) nach Gegenpartei darf nur bei Mittelflüssen in dieser Währung angewendet werden.</p> |
| 0250 | <p>1.1.10. Zuflüsse aus nicht in Anspruch genommenen Kredit- bzw. Liquiditätsfazilitäten, die durch Mitglieder einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems bereitgestellt wurden, wobei die zuständige Behörde die Anwendung einer günstigeren Zuflussrate genehmigt hat</p> <p>Artikel 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Zuflüsse aus nicht in Anspruch genommenen Kredit- bzw. Liquiditätsfazilitäten, die durch Mitglieder einer Gruppe oder eines</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>institutsbezogenen Sicherungssystems bereitgestellt wurden, wobei die zuständige Behörde die Anwendung einer günstigeren Zuflussrate gemäß Artikel 34 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 genehmigt hat.</p> |
| 0260 | <p>1.1.11. Andere Zuflüsse</p> <p>Artikel 32 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Alle anderen Zuflüsse gemäß Artikel 32 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61, die nicht an anderer Stelle im Meldebogen ausgewiesen wurden.</p> |
| 0263 | <p>1.2. Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstaben b, c und f der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 beziehen sich auf Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0263 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen; und <input type="checkbox"/> für die Spalten 0140, 0150 und 0160 die Summe der Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen. <p>Sicherheitswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, werden nicht hier, sondern in Anhang XXIV Abschnitt 75.01. gemeldet.</p> |
| 0265 | <p>1.2.1. Gegenpartei ist Zentralbank</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne von Artikel 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0265 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist; und <input type="checkbox"/> für die Spalten 0140, 0150 und 0160 die gesamten Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist. |
| 0267 | <p>1.2.1.1. Sicherheiten, die als liquide Aktiva anerkannt werden</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0267 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 jeweils den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens |

| | |
|------|---|
| | <p>30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch liquide Aktiva besichert ist; und</p> <ul style="list-style-type: none"> ▪ für die Spalten 0140, 0150 und 0160 jeweils die gesamten Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch liquide Aktiva besichert ist. <p>Die Kreditinstitute melden besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch liquide Aktiva besichert ist, unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, und unabhängig davon, ob die erhaltenen liquiden Aktiva die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0269 | <p>1.2.1.1.1. Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 10 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva einer der in Artikel 10 genannten Kategorien von Aktiva der Stufe 1 eingestuft würden, mit Ausnahmeder in Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe f genannten gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität.</p> |
| 0271 | <p>1.2.1.1.1.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.1.1.1 gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0273 | <p>1.2.1.1.2. Sicherheiten der Stufe 1 in Form gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 10 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva der in Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe f genannten Kategorie eingestuft würden.</p> |
| 0275 | <p>1.2.1.1.2.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> |

| | |
|------|---|
| | Von den unter 1.2.1.1.2 gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen. |
| 0277 | <p>1.2.1.1.3. Sicherheiten der Stufe 2A</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 11 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva einer der in Artikel 11 genannten Kategorien von Aktiva der Stufe 2A eingestuft würden.</p> |
| 0279 | <p>1.2.1.1.3.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.1.1.3 gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0281 | <p>1.2.1.1.4. Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz)</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva einer der in Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern i, ii oder iv genannten Kategorien von Aktiva der Stufe 2B eingestuft würden.</p> |
| 0283 | <p>1.2.1.1.4.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.1.1.4 gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0285 | <p>1.2.1.1.5. Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva der in Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe e genannten Kategorie von Aktiva der Stufe 2B eingestuft würden.</p> |

| | |
|------|--|
| 0287 | <p>1.2.1.1.5.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.1.1.5 gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0289 | <p>1.2.1.1.6. Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen)</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva einer der in Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern iii oder v genannten Kategorien von Aktiva der Stufe 2B eingestuft würden.</p> |
| 0291 | <p>1.2.1.1.6.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.1.1.6 gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0293 | <p>1.2.1.1.7. Sicherheiten der Stufe 2B, die nicht bereits in den Abschnitten 1.2.1.1.4., 1.2.1.1.5. oder 1.2.1.1.6. erfasst wurden</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva der in Artikel 12 Absatz 1 Buchstaben b, c oder f genannten Kategorien von Aktiva der Stufe 2B eingestuft würden.</p> |
| 0295 | <p>1.2.1.1.7.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.1.1.7 gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0297 | <p>1.2.1.2. Sicherheiten zur Deckung von Leerverkaufspositionen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die gemäß</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Artikel 30 Absatz 5 Satz 2 zur Deckung einer Leerverkaufsposition verwendet werden. Werden Sicherheiten irgendeines Typs zur Deckung von Leerverkaufspositionen eingesetzt, werden diese hier und nicht in einer der obigen Zeilen ausgewiesen. Solche Sicherheiten dürfen nicht doppelt erfasst werden.</p> |
| 0299 | <p>1.2.1.3. Sicherheiten, die nicht als liquide Aktiva anerkannt werden</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0299 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und die Sicherheiten nicht als liquide Aktiva gelten. Die Kreditinstitute melden</p> <ul style="list-style-type: none"> ▪ für die Spalten 0010, 0020 und 0030 jeweils den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen aus diesen Transaktionen als Summe der fälligen Zahlungen aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, wobei die Sicherheiten nicht liquide Eigenmittel sind, und aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, die durch andere nicht liquide Sicherheiten besichert sind; und ▪ für die Spalten 0140, 0150 und 0160 jeweils den Gesamtbetrag der Zuflüsse aus diesen Transaktionen als Summe der Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, wobei die Sicherheiten nicht liquide Eigenmittel sind, und aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, die durch andere nicht liquide Sicherheiten besichert sind. |
| 0301 | <p>1.2.1.3.1. Sicherheiten sind nicht liquide Eigenmittel</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch nicht liquide Eigenmittel besichert ist.</p> |
| 0303 | <p>1.2.1.3.2. Alle anderen nicht liquiden Sicherheiten</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank und das Geschäft durch nicht liquide Aktiva besichert ist, die nicht schon in Abschnitt 1.2.1.3.1. erfasst sind.</p> |
| 0305 | <p>1.2.2. Gegenpartei ist keine Zentralbank</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen im Sinne von Artikel 192 Nummern 2 und 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0305 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 jeweils den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen aus besicherten Kreditvergaben und |

| | |
|------|---|
| | <p>Kapitalmarkttransaktionen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist; und</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0140, 0150 und 0160 jeweils die gesamten Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist. |
| 0307 | <p>1.2.2.1. Sicherheiten, die als liquide Aktiva anerkannt werden</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0307 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 jeweils den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch liquide Aktiva besichert ist; und ▪ für die Spalten 0140, 0150 und 0160 jeweils die gesamten Zuflüsse aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch liquide Aktiva besichert ist. <p>Die Kreditinstitute melden besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch liquide Aktiva besichert ist, unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, und unabhängig davon, ob die erhaltenen liquiden Aktiva die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0309 | <p>1.2.2.1.1. Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 10 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva einer der in Artikel 10 genannten Kategorien von Aktiva der Stufe 1 eingestuft würden, mit Ausnahmeder in Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe f genannten gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität.</p> |
| 0311 | <p>1.2.2.1.1.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.2.1.1. gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0313 | <p>1.2.2.1.2. Sicherheiten der Stufe 1 in Form gedeckter Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 10 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva der in Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe f genannten Kategorie eingestuft würden.</p> |
| 0315 | <p>1.2.2.1.2.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.2.1.2. gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0317 | <p>1.2.2.1.3. Sicherheiten der Stufe 2A</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 11 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva einer der in Artikel 11 genannten Kategorien von Aktiva der Stufe 2A eingestuft würden.</p> |
| 0319 | <p>1.2.2.1.3.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.</p> <p>Von den unter 1.2.2.1.3. gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0321 | <p>1.2.2.1.4. Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz)</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva einer der in Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern i, ii oder iv genannten Kategorien von Aktiva der Stufe 2B eingestuft würden.</p> |
| 0323 | <p>1.2.2.1.4.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> |

| | |
|------|--|
| | Von den unter 1.2.2.1.4. gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen. |
| 0325 | <p>1.2.2.1.5. Sicherheiten in Form gedeckter Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva der in Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe e genannten Kategorie von Aktiva der Stufe 2B eingestuft würden.</p> |
| 0327 | <p>1.2.2.1.5.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.2.1.5. gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0329 | <p>1.2.2.1.6. Sicherheiten in Form forderungsbesicherter Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen)</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 13 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide Aktiva einer der in Artikel 13 Absatz 2 Buchstabe g Ziffern iii oder v genannten Kategorien von Aktiva der Stufe 2B eingestuft würden.</p> |
| 0331 | <p>1.2.1.1.6.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.2.1.6. gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0333 | <p>1.2.2.1.7. Sicherheiten der Stufe 2B, die nicht bereits in den Abschnitten 1.2.2.1.4., 1.2.2.1.5. oder 1.2.2.1.6. erfasst wurden</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die unabhängig davon, ob sie bei einem anderen Geschäft wiederverwendet werden, nach den Artikel 7 und 12 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquide</p> |

| | |
|------|--|
| | Aktiva der in Artikel 12 Absatz 1 Buchstaben b, c oder f genannten Kategorien von Aktiva der Stufe 2B eingestuft würden. |
| 0335 | <p>1.2.2.1.7.1. Davon: Empfangene Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Von den unter 1.2.2.1.7. gemeldeten Geschäften diejenigen, bei denen die empfangenen Sicherheiten die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen.</p> |
| 0337 | <p>1.2.2.2. Sicherheiten zur Deckung von Leerverkaufspositionen</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch Aktiva besichert ist, die gemäß Artikel 30 Absatz 5 Satz 2 zur Deckung einer Leerverkaufsposition verwendet werden. Werden Sicherheiten irgendeines Typs zur Deckung von Leerverkaufspositionen eingesetzt, werden diese hier und nicht in einer der obigen Zeilen ausgewiesen. Solche Sicherheiten dürfen nicht doppelt erfasst werden.</p> |
| 339 | <p>1.2.2.3. Sicherheiten, die nicht als liquide Aktiva anerkannt werden</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0339 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und die Sicherheiten nicht als liquide Aktiva gelten. Die Kreditinstitute melden</p> <ul style="list-style-type: none"> □ für die Spalten 0010, 0020 und 0030 jeweils den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen aus diesen Transaktionen als Summe der fälligen Zahlungen aus Lombardgeschäften, wobei die Sicherheiten nicht liquide sind, aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, wobei die Sicherheiten nicht liquide Eigenmittel sind, und aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, die durch andere nicht liquide Sicherheiten besichert sind; und ▪ für die Spalten 0140, 0150 und 0160 jeweils die gesamten Zuflüsse aus diesen Transaktionen als Summe der Zuflüsse aus Lombardgeschäften, wobei die Sicherheiten nicht liquide sind, aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, wobei die Sicherheiten nicht liquide Eigenmittel sind, und aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen, die durch andere nicht liquide Sicherheiten besichert sind. |
| 0341 | <p>1.2.2.3.1. Lombardgeschäfte: Sicherheiten sind nicht liquide</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Lombardgeschäfte, die gegen Sicherheiten in Form nicht liquider Aktiva getätigt werden, mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank ist und die empfangenen Vermögenswerte</p> |

| | |
|----------------------------|--|
| | gemäß Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 nicht zur Deckung von Leerverkaufspositionen verwendet werden. |
| 0343 | <p>1.2.2.3.2. Sicherheiten sind nicht liquide Eigenmittel</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch nicht liquide Eigenmittel besichert ist.</p> |
| 0345 | <p>1.2.2.3.3. Alle anderen nicht liquiden Sicherheiten</p> <p>Artikel 32 Absatz 3 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Besicherte Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei keine Zentralbank und das Geschäft durch nicht liquide Aktiva besichert ist, die nicht schon in Abschnitt 1.2.2.3.1. oder 1.2.2.3.2. erfasst sind.</p> |
| 0410 | <p>1.3. Summe der Zuflüsse aus Sicherheitenswaps</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier die Summe der Zuflüsse aus Sicherheitenswaps, wie im Meldebogen C 75.01 in Anhang XXIV berechnet.</p> |
| 0420 | <p>1.4. (Differenz zwischen der Summe der gewichteten Zuflüsse und der Summe der gewichteten Abflüsse aus Drittländern, in denen Transferbeschränkungen gelten, oder die auf nichtkonvertierbare Währungen lauten)</p> <p>Artikel 32 Absatz 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden in den jeweiligen Spalten 0140, 0150 und 0160 die Summe der gesamten gewichteten Zuflüsse aus Drittländern, in denen Transferbeschränkungen gelten, oder die auf nichtkonvertierbare Währungen lauten, abzüglich der Summe der in Anhang XXIV Meldebogen C 73.00 ausgewiesenen gewichteten Abflüsse in Drittländer, in denen Transferbeschränkungen gelten, oder die auf nichtkonvertierbare Währungen lauten. Im Falle eines negativen Betrags melden die Kreditinstitute „0“.</p> |
| 0430 | <p>1.5. (Überschüssige Zuflüsse von einem verbundenen spezialisierten Kreditinstitut)</p> <p>Artikel 2 Absatz 3 Buchstabe e und Artikel 33 Absatz 6 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Kreditinstitute, die auf konsolidierter Basis melden, geben in den jeweiligen Spalten 0140, 0150 oder 0160 den Betrag der Zuflüsse von einem verbundenen spezialisierten Kreditinstitut im Sinne des Artikels 33 Absätze 3 und 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 an, die den Betrag der Abflüsse aus demselben Institut überschreiten.</p> |
| ZUSATZINFORMATIONEN | |
| 0450 | <p>2. Fremdwährungszuflüsse</p> <p>Diese Zusatzinformation wird nur im Falle einer gesonderten Meldung in der Meldewährung oder einer anderen Währung als der Meldewährung gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgewiesen.</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Die Kreditinstitute melden den Anteil der Zuflüsse aus Derivaten (gemeldet in Abschnitt 1.1.9.), die sich auf Fremdwährungs-Kapitalströme in der entsprechenden Währung aus währungsübergreifenden Swaps sowie Devisenkassa- und -termingeschäften, die innerhalb der 30-Tage-Frist fällig werden, beziehen. Die Aufrechnung (Netting) nach Gegenpartei darf nur bei Mittelflüssen in dieser Währung angewendet werden.</p> |
| 0460 | <p>3. Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier als Zusatzinformationen alle in Abschnitt 1 (ausgenommen Abschnitt 1.1.10.) gemeldeten Geschäfte, bei denen die Gegenpartei das Mutter- oder Tochterinstitut des Kreditinstituts oder ein anderes Tochterunternehmen desselben Mutterinstituts ist oder mit dem Kreditinstitut durch eine Beziehung im Sinne des Artikels 12 Absatz 1 der Richtlinie 83/349/EWG verbunden oder Mitglied desselben institutsbezogenen Sicherungssystems gemäß Artikel 113 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder das Zentralinstitut oder ein Mitglied eines Verbunds oder einer genossenschaftlichen Gruppe gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist.</p> <p>Die Kreditinstitute melden in Zeile 0460 des Meldebogens C 74.00 in Anhang XXIV</p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> für die Spalten 0010, 0020 und 0030 jeweils den Gesamtbetrag der fälligen Zahlungen/Höchstbeträge, die in Anspruch genommen werden können, innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems als Summe der fälligen Zahlungen/Höchstbeträge, die in Anspruch genommen werden können, innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems nach Transaktionsart und Gegenpartei; und <input type="checkbox"/> für die Spalten 0140, 0150 und 0160 jeweils die Summe der Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems als Summe der Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen nach Transaktionsart und Gegenpartei. |
| 0470 | <p>3.1. Fällige Zahlungen von Nichtfinanzkunden (ausgenommen Zentralbanken)</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier alle in Abschnitt 1.1.1. gemeldeten Geschäfte, bei denen die Gegenpartei das Mutter- oder Tochterinstitut des Kreditinstituts oder ein anderes Tochterunternehmen desselben Mutterinstituts ist oder mit dem Kreditinstitut durch eine Beziehung im Sinne des Artikels 12 Absatz 1 der Richtlinie 83/349/EWG verbunden oder Mitglied desselben institutsbezogenen Sicherungssystems gemäß Artikel 113 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder das Zentralinstitut oder ein Mitglied eines Verbunds oder einer genossenschaftlichen Gruppe gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist.</p> |
| 0480 | <p>3.2. Fällige Zahlungen von Finanzkunden</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier alle in Abschnitt 1.1.2. gemeldeten fälligen Zahlungen von Finanzkunden, bei denen die Gegenpartei das Mutter- oder Tochterinstitut des Kreditinstituts oder ein anderes Tochterunternehmen</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>desselben Mutterinstituts ist oder mit dem Kreditinstitut durch eine Beziehung im Sinne des Artikels 12 Absatz 1 der Richtlinie 83/349/EWG verbunden oder Mitglied desselben institutsbezogenen Sicherungssystems gemäß Artikel 113 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder das Zentralinstitut oder ein Mitglied eines Verbunds oder einer genossenschaftlichen Gruppe gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist.</p> |
| 0490 | <p>3.3. Besicherte Transaktionen</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier alle fälligen Zahlungen aus besicherten Kreditvergaben und Kapitalmarkttransaktionen sowie den Gesamtmarktwert der in Abschnitt 1.2. gemeldeten empfangenen Sicherheiten, bei denen die Gegenpartei das Mutter- oder Tochterinstitut des Kreditinstituts oder ein anderes Tochterunternehmen desselben Mutterinstituts ist oder mit dem Kreditinstitut durch eine Beziehung im Sinne des Artikels 12 Absatz 1 der Richtlinie 83/349/EWG verbunden oder Mitglied desselben institutsbezogenen Sicherungssystems gemäß Artikel 113 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder das Zentralinstitut oder ein Mitglied eines Verbunds oder einer genossenschaftlichen Gruppe gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist.</p> |
| 0500 | <p>3.4. Fällige Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier alle in Abschnitt 1.1.5. gemeldeten Zahlungen aus Wertpapieren, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, bei denen der Emittent das Mutter- oder Tochterinstitut des Kreditinstituts oder ein anderes Tochterunternehmen desselben Mutterinstituts ist oder mit dem Kreditinstitut durch eine Beziehung im Sinne des Artikels 12 Absatz 1 der Richtlinie 83/349/EWG verbunden oder Mitglied desselben institutsbezogenen Sicherungssystems gemäß Artikel 113 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder das Zentralinstitut oder ein Mitglied eines Verbunds oder einer genossenschaftlichen Gruppe gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist.</p> |
| 0510 | <p>3.5. Andere Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier alle anderen in Abschnitt 1.1.3. bis 1.1.11 gemeldeten Zuflüsse innerhalb einer Gruppe oder eines institutsbezogenen Sicherungssystems (mit Ausnahme von Abschnitt 1.1.5. und 1.1.10.), bei denen die Gegenpartei das Mutter- oder Tochterinstitut des Kreditinstituts oder ein anderes Tochterunternehmen desselben Mutterinstituts ist oder mit dem Kreditinstitut durch eine Beziehung im Sinne des Artikels 12 Absatz 1 der Richtlinie 83/349/EWG verbunden oder Mitglied desselben institutsbezogenen Sicherungssystems gemäß Artikel 113 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder das Zentralinstitut oder ein Mitglied eines Verbunds oder einer genossenschaftlichen Gruppe gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ist.</p> |
| | <p>4. Von Artikel 17 Absätze 2 und 3 freigestellte besicherte Finanzierungsgeschäfte</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Kreditvergaben mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 0530 | <p>4.1. davon: besichert durch Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Kreditvergaben, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den empfangenen Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und wobei die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 0540 | <p>4.2. davon: besichert durch gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Kreditvergaben, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den empfangenen Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und wobei die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 0550 | <p>4.3. davon: besichert durch Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Kreditvergaben, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den empfangenen Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 2A handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und wobei die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 0560 | <p>4.4. davon: besichert durch Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Kreditvergaben, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist und es sich bei den empfangenen Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 2B handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und wobei die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 0570 | <p>4.5. davon: besichert durch nicht liquide Aktiva</p> |

| | |
|--|---|
| | <p>Hier melden die Kreditinstitute besicherte Kreditvergaben, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist, es sich bei der empfangenen Sicherheit um eine nicht liquide Sicherheit handelt und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
|--|---|

TEIL 4: SICHERHEITENSWAPS

1. Sicherheitenswaps

1.1. Allgemeine Bemerkungen

1. In diesem Meldebogen werden sämtliche innerhalb der nächsten 30 Kalendertage fällig werdenden Transaktionen, bei denen unbare Aktiva gegen andere unbare Aktiva getauscht werden, gemeldet. Posten, zu denen die Institute keine Angaben machen müssen, sind grau hinterlegt.
2. Bei Sicherheitenswaps, die innerhalb der nächsten 30 Kalendertage fällig werden, wird ein Abfluss angesetzt, wenn der geliehene Vermögenswert nach Kapitel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 einem geringeren Haircut unterliegt als der verliehene Vermögenswert. Berechnet wird der Abfluss durch Multiplikation des Marktwerts des geliehenen Vermögenswerts mit der Differenz zwischen der Abflussrate, die auf den verliehenen Vermögenswert und der Abflussrate, die auf den geliehenen Vermögenswert bei innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werdenden besicherten Finanzierungsgeschäften anwendbar ist. Handelt es sich bei der Gegenpartei um die inländische Zentralbank des Kreditinstituts, so wird auf den Marktwert des geliehenen Vermögenswerts eine Abflussrate von 0 % angewandt. Die inländische Zentralbank des Kreditinstituts ist die inländische Zentralbank im Sinne der Begriffsbestimmung in Artikel 28 Absatz 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61.
3. Bei Sicherheitenswaps, die innerhalb der nächsten 30 Kalendertage fällig werden, wird ein Zufluss angesetzt, wenn der verliehene Vermögenswert nach Kapitel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 einem geringeren Haircut unterliegt als der geliehene Vermögenswert. Berechnet wird der Zufluss durch Multiplikation des Marktwerts des verliehenen Vermögenswerts mit der Differenz zwischen der Zuflussrate, die auf den geliehenen Vermögenswert und der Zuflussrate, die auf den verliehenen Vermögenswert bei innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werdenden besicherten Finanzierungsgeschäften anwendbar ist. Wird die empfangene Sicherheit zur Deckung von Leerverkaufspositionen verwendet, die über 30 Kalendertage hinaus verlängert werden können, wird kein Zufluss ausgewiesen.
4. Bei liquiden Aktiva wird der Liquiditätswert gemäß Artikel 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 berechnet.
5. Jeder Sicherheitenswap wird einzeln bewertet und der Mittelfluss entweder als Abfluss oder Zufluss (je Transaktion) in der entsprechenden Zeile ausgewiesen. Wenn ein Handel verschiedene Sicherheitenkategorien (z. B. Korb von Sicherheiten) umfasst, wird er zu Meldezwecken in Teile entsprechend den Meldebogenzeilen aufgeteilt und in Teilen bewertet. Bei Swapgeschäften mit Sicherheitenkörben oder -pools, die innerhalb der nächsten 30 Kalendertage fällig werden, werden die verliehenen unbaren Aktiva den geliehenen unbaren Aktiva entsprechend den in Titel II Kapitel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 festgelegten Kategorien liquider Aktiva einzeln zugeordnet, angefangen mit der am wenigsten liquiden Kombination (d. h. verliehene nicht liquide unbare Aktiva, geliehene nicht liquide unbare Aktiva). Etwaige überschüssige Sicherheiten innerhalb einer Kombination werden in die höhere Kategorie verschoben, sodass die entsprechenden Kombinationen bis hin zur liquidesten Kombination vollständig ausgeglichen sind. Etwaige insgesamt

überschüssige Sicherheiten werden sodann bei der liquidesten Kombination erfasst.

6. Sicherheitenswaps mit Aktien oder Anteilen von OGA werden so gemeldet, als beinhalteten die betreffenden Geschäfte die dem OGA zugrunde liegenden Vermögenswerte. Die unterschiedlichen auf Aktien oder Anteile an OGA angewandten Abschläge müssen sich in der jeweils zu meldenden Ab- oder Zuflussrate widerspiegeln.
7. Die Kreditinstitute füllen den Meldebogen in den entsprechenden Währungen gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) 575/2013 aus. In diesem Falle umfassen die gemeldeten Salden nur die auf die jeweilige Währung lautenden Salden, um sicherzustellen, dass Währungsabweichungen korrekt widerspiegelt werden. Dies kann bedeuten, dass nur eine Seite des Geschäfts im Meldebogen für die jeweilige Währung ausgewiesen wird, mit entsprechenden Auswirkungen auf den überschüssigen Liquiditätswert.

1.2. Besondere Bemerkungen

8. Zur Berechnung der Zuflüsse oder Abflüsse werden Sicherheitenswaps unabhängig davon gemeldet, ob die zugrunde liegende Sicherheit die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt oder erfüllen würde, wenn sie nicht schon als Sicherheit für das betreffende Geschäft verwendet würde. Zur Berechnung des angepassten Bestands liquider Aktiva gemäß Artikel 17 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 melden die Kreditinstitute außerdem jene Transaktionen gesondert, bei denen zumindest eine Komponente der Sicherheit die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.
9. Wenn ein Institut nur einen Teil seiner Aktien, Zentralstaat- oder Bankaktiva in Fremdwährung bzw. seiner Zentralstaat- oder Bankaktiva in Landeswährung innerhalb seiner erstklassigen liquiden Aktiva ansetzen kann, wird nur der ansetzbare Teil in den Zeilen für Aktiva der Stufen 1, 2A und 2B gemeldet (gemäß Artikel 12 Absatz 1 Buchstabe c Ziffer ii und Artikel 10 Absatz 1 Buchstabe d der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61). Wird der betreffende Vermögenswert als Sicherheit verwendet, jedoch in einer Höhe, die den innerhalb der liquiden Aktiva ansetzbaren Teil übersteigt, wird der überschüssige Betrag in dem Abschnitt für nicht liquide Aktiva gemeldet.
10. Sicherheitenswaps in Verbindung mit Aktiva der Stufe 2A werden in der entsprechenden Zeile für solche Aktiva der Stufe 2A gemeldet, selbst wenn der Alternative Liquiditätsansatz befolgt wird (d. h., dass Aktiva der Stufe 2A bei der Meldung von Sicherheitenswaps nicht in Stufe 1 verschoben werden dürfen).

1.3. Einzelvorlage Sicherheitenswaps

1.3.1 Erläuterungen zu bestimmten Spalten

| Spalte | Rechtsgrundlagen und Erläuterungen |
|--------|--|
| 0010 | <p>Marktwert der verliehenen Sicherheiten</p> <p>Der Marktwert der verliehenen Sicherheiten wird in Spalte 0010 gemeldet. Der Marktwert spiegelt den aktuellen Marktwert vor Abzug des Abschlags und nach Berücksichtigung der Ab- und Zuflüsse infolge</p> |

| | |
|------|--|
| | der Abwicklung der zugehörigen Sicherungsgeschäfte gemäß Artikel 8 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 wider. |
| 0020 | Liquiditätswert der verliehenen Sicherheiten Der Liquiditätswert der verliehenen Sicherheiten wird in Spalte 0020 gemeldet. Bei flüssigen Aktiva spiegelt der Liquiditätswert den Wert der Aktiva nach Berücksichtigung des Abschlags wider. |
| 0030 | Marktwert der geliehenen Sicherheiten Der Marktwert der geliehenen Sicherheiten wird in Spalte 0030 gemeldet. Der Marktwert spiegelt den aktuellen Marktwert vor Abzug des Abschlags und nach Berücksichtigung der Ab- und Zuflüsse infolge der Abwicklung der zugehörigen Sicherungsgeschäfte gemäß Artikel 8 Absatz 5 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 wider. |
| 0040 | Liquiditätswert der geliehenen Sicherheiten Der Liquiditätswert der geliehenen Sicherheiten wird in Spalte 0040 gemeldet. Bei flüssigen Aktiva spiegelt der Liquiditätswert den Wert der Aktiva nach Berücksichtigung des Abschlags wider. |
| 0050 | Standardgewichtung Artikel 28 und 32 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Die Standardgewichtungen in Spalte 0050 entsprechen denjenigen, die in der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 standardmäßig angegeben sind, und werden hier nur zur Information bereitgestellt. |
| 0060 | Anwendbare Gewichtung Artikel 28 und 32 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Diese anwendbaren Gewichtungen entsprechen denjenigen, die in den Artikeln 28 und 32 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 angegeben sind. Anwendbare Gewichtungen können zu gewichteten Durchschnittswerten führen und werden im Dezimalformat gemeldet (z. B. 1,00 für eine anwendbare Gewichtung von 100 Prozent oder 0,50 für eine anwendbare Gewichtung von 50 Prozent). Anwendbare Gewichtungen können u. a. unternehmensspezifische und nationale Ermessensspielräume widerspiegeln. |
| 0070 | Abflüsse Die Kreditinstitute melden hier die Abflüsse. Dieser Wert wird durch Multiplikation der Spalte 0060 mit der Spalte 0030 des Meldebogens C 75.01 in Anhang XXIV ermittelt. |
| 0080 | Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse Hier melden die Kreditinstitute die Zuflüsse für Transaktionen, die der Obergrenze von 75 % für Zuflüsse unterliegen. Die Zuflüsse werden durch Multiplikation der Spalte 0060 mit der Spalte 0010 des Meldebogens C 75.01 in Anhang XXIV ermittelt. |
| 0090 | Zuflüsse mit der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse Hier melden die Kreditinstitute die Zuflüsse für Transaktionen, die der Obergrenze von 90 % für Zuflüsse unterliegen. Die Zuflüsse werden |

| | |
|------|---|
| | durch Multiplikation der Spalte 0060 mit der Spalte 0010 des Meldebogens C 75.01 in Anhang XXIV ermittelt. |
| 0100 | Zuflüsse — von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen Hier melden die Kreditinstitute die Zuflüsse für Transaktionen, die von der Obergrenze für Zuflüsse ausgenommen sind. Die Zuflüsse werden durch Multiplikation der Spalte 0060 mit der Spalte 0010 des Meldebogens C 75.01 in Anhang XXIV ermittelt. |

1.3.2 Erläuterungen zu bestimmten Zeilen

| Zeile | Rechtsgrundlagen und Erläuterungen |
|--------------|--|
| 0010 | 1. SICHERHEITENSWAPS INSGESAMT (Gegenpartei ist Zentralbank) Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Die Kreditinstitute melden hier für die jeweiligen Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenswaps. |
| 0020 | 1.1. Summe der Transaktionen, bei denen Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität) verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden: Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Die Kreditinstitute melden hier für jede betreffende Spalte die Gesamtwerte der Sicherheitenswaps für Transaktionen, bei denen Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität) verliehen wurden. |
| 0030 | 1.1.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität) Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat. |
| 0040 | Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.1.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |

| | |
|------|--|
| 0050 | <p>1.1.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0060 | <p>1.1.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.1.2. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0070 | <p>1.1.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0080 | <p>1.1.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.1.3. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0090 | <p>1.1.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0100 | <p>1.1.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.1.4. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> |

| | |
|------|---|
| | die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 0110 | 1.1.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 0120 | 1.1.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.1.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 0130 | 1.1.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 0140 | 1.1.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.1.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 0150 | 1.1.7. Andere Aktiva der Stufe 2B Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 0160 | 1.1.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.1.7. melden die Kreditinstitute |

| | |
|------|--|
| | <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0170 | <p>1.1.8. Nicht liquide Aktiva</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0180 | <p>1.1.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.1.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde;</p> |
| 0190 | <p>1.2. Summe der Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenwaps für Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 verliehen wurden.</p> |
| 0200 | <p>1.2.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0210 | <p>1.2.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.2.1. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |

| | |
|------|---|
| 0220 | <p>1.2.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0230 | <p>1.2.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.2.2. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0240 | <p>1.2.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0250 | <p>1.2.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.2.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0260 | <p>1.2.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0270 | <p>1.2.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.2.4. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> |

| | |
|------|---|
| | die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 0280 | <p>1.2.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0290 | <p>1.2.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.2.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0300 | <p>1.2.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0310 | <p>1.2.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.2.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0320 | <p>1.2.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0330 | <p>1.2.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.2.7. melden die Kreditinstitute</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0340 | <p>1.2.8. Nicht liquide Aktiva</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0350 | <p>1.2.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.2.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde;</p> |
| 0360 | <p>1.3. Summe der Transaktionen, bei denen Aktiva der Stufe 2A verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenwaps für Transaktionen, bei denen Aktiva der Stufe 2A verliehen wurden.</p> |
| 0370 | <p>1.3.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0380 | <p>1.3.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.3.1. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0390 | <p>1.3.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> |

| | |
|------|---|
| | Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat. |
| 0400 | <p>1.3.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.3.2. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0410 | <p>1.3.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0420 | <p>1.3.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.3.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0430 | <p>1.3.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0440 | <p>1.3.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.3.4. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0450 | 1.3.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität |

| | |
|------|---|
| | Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 0460 | <p>1.3.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.3.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0470 | <p>1.3.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0480 | <p>1.3.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.3.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0490 | <p>1.3.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0500 | <p>1.3.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.3.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0510 | 1.3.8. Nicht liquide Aktiva |

| | |
|------|---|
| | Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat. |
| 0520 | <p>1.3.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.3.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde;</p> |
| 0530 | <p>1.4. Summe der Transaktionen, bei denen forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenwaps für Transaktionen, bei denen forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) verliehen wurden.</p> |
| 0540 | <p>1.4.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0550 | <p>1.4.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.4.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0560 | <p>1.4.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0570 | <p>1.4.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.4.2. melden die Kreditinstitute</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0580 | <p>1.4.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0590 | <p>1.4.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.4.3. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0600 | <p>1.4.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0610 | <p>1.4.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.4.4. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0620 | <p>1.4.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |

| | |
|------|---|
| 0630 | <p>1.4.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.4.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0640 | <p>1.4.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0650 | <p>1.4.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.4.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0660 | <p>1.4.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0670 | <p>1.4.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.4.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0680 | <p>1.4.8. Nicht liquide Aktiva</p> |

| | |
|------|--|
| | Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat. |
| 0690 | 1.4.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.4.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; |
| 0700 | 1.5. Summe der Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden: Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheiten-swaps für Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B verliehen wurden. |
| 0710 | 1.5.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität) Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat. |
| 0720 | 1.5.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.5.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 0730 | 1.5.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat. |
| 0740 | 1.5.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.5.2. melden die Kreditinstitute |

| | |
|------|--|
| | <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0750 | <p>1.5.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0760 | <p>1.5.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.5.3. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0770 | <p>1.5.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0780 | <p>1.5.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.5.4. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0790 | <p>1.5.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |

| | |
|------|---|
| 0800 | <p>1.5.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.5.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0810 | <p>1.5.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0820 | <p>1.5.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.5.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0830 | <p>1.5.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0840 | <p>1.5.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.5.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0850 | <p>1.5.8. Nicht liquide Aktiva</p> |

| | |
|------|---|
| | Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat. |
| 0860 | <p>1.5.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.5.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde;</p> |
| 0870 | <p>1.6. Summe der Transaktionen, bei denen forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenwaps für Transaktionen, bei denen forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) verliehen wurden.</p> |
| 0880 | <p>1.6.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0890 | <p>1.6.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.6.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0900 | <p>1.6.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |

| | |
|------|---|
| 0910 | <p>1.6.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.6.2. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0920 | <p>1.6.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0930 | <p>1.6.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.6.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0940 | <p>1.6.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0950 | <p>1.6.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.6.4. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0960 | <p>1.6.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0970 | <p>1.6.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.6.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 0980 | <p>1.6.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 0990 | <p>1.6.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.6.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1000 | <p>1.6.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1010 | <p>1.6.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.6.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> |

| | |
|------|--|
| | die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1020 | 1.6.8. Nicht liquide Aktiva Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat. |
| 1030 | 1.6.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.6.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; |
| 1040 | 1.7. Summe der Transaktionen, bei denen andere Aktiva der Stufe 2B verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden: Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheiten-swaps für Transaktionen, bei denen andere Aktiva der Stufe 2B verliehen wurden. |
| 1050 | 1.7.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität) Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat. |
| 1060 | 1.7.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.7.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1070 | 1.7.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat. |
| 1080 | 1.7.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen |

| | |
|------|---|
| | <p>Für die Geschäfte unter 1.7.2. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1090 | <p>1.7.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1100 | <p>1.7.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.7.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1110 | <p>1.7.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1120 | <p>1.7.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.7.4. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1130 | <p>1.7.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1140 | <p>1.7.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Für die Geschäfte unter 1.7.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1150 | <p>1.7.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1160 | <p>1.7.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.7.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1170 | <p>1.7.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1180 | <p>1.7.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.7.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1190 | <p>1.7.8. Nicht liquide Aktiva</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1200 | <p>1.7.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> |

| | |
|------|---|
| | Für die Geschäfte unter 1.7.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; |
| 1210 | <p>1.8. Summe der Transaktionen, bei denen nicht liquide Aktiva verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheiten-swaps für Transaktionen, bei denen nicht liquide Aktiva verliehen wurden.</p> |
| 1220 | <p>1.8.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1230 | <p>1.8.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.8.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1240 | <p>1.8.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1250 | <p>1.8.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.8.2. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1260 | <p>1.8.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1270 | <p>1.8.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 1.8.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1280 | <p>1.8.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> |

| | |
|------|--|
| | Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 1290 | 1.8.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.8.4. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1300 | 1.8.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 1310 | 1.8.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.8.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1320 | 1.8.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 1330 | 1.8.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.8.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1340 | 1.8.7. Andere Aktiva der Stufe 2B Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 1350 | 1.8.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 1.8.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1360 | 1.8.8. Nicht liquide Aktiva Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat. |
| 1370 | 2. SICHERHEITENSWAPS INSGESAMT (Gegenpartei ist keine Zentralbank) |

| | |
|------|---|
| | <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die jeweiligen Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenswaps.</p> |
| 1380 | <p>2.1. Summe der Transaktionen, bei denen Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität) verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für jede betreffende Spalte die Gesamtwerte der Sicherheitenswaps für Transaktionen, bei denen Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität) verliehen wurden.</p> |
| 1390 | <p>2.1.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1400 | <p>1 Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.1.1. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1410 | <p>2.1.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1420 | <p>2.1.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.1.2. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> |

| | |
|------|---|
| | die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1430 | 2.1.3. Aktiva der Stufe 2A Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat. |
| 1440 | 2.1.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.1.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1450 | 2.1.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 1460 | 2.1.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.1.4. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1470 | 2.1.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 1480 | 2.1.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.1.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der |

| | |
|------|--|
| | <p>Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1490 | <p>2.1.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1500 | <p>2.1.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.1.6. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1510 | <p>2.1.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1520 | <p>2.1.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.1.7. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1530 | <p>2.1.8. Nicht liquide Aktiva</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1540 | <p>2.1.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> |

| | |
|------|---|
| | Für die Geschäfte unter 2.1.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; |
| 1550 | <p>2.2. Summe der Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenwaps für Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 verliehen wurden.</p> |
| 1560 | <p>2.2.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1570 | <p>2.2.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.2.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1580 | <p>2.2.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1590 | <p>2.2.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.2.2. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> |

| | |
|------|--|
| | die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1600 | 2.2.3. Aktiva der Stufe 2A Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat. |
| 1610 | 2.2.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.2.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1620 | 2.2.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 1630 | 2.2.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.2.4. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 1640 | 2.2.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 1650 | 2.2.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.2.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der |

| | |
|------|--|
| | <p>Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1660 | <p>2.2.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1670 | <p>2.2.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.2.6. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1680 | <p>2.2.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1690 | <p>2.2.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.2.7. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1700 | <p>2.2.8. Nicht liquide Aktiva</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1710 | <p>2.2.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> |

| | |
|------|---|
| | Für die Geschäfte unter 2.2.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; |
| 1720 | <p>2.3. Summe der Transaktionen, bei denen Aktiva der Stufe 2A verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenwaps für Transaktionen, bei denen Aktiva der Stufe 2A verliehen wurden.</p> |
| 1730 | <p>2.3.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1740 | <p>2.3.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.3.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1750 | <p>2.3.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1760 | <p>2.3.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.3.2. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1770 | 2.3.3. Aktiva der Stufe 2A |

| | |
|------|---|
| | Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat. |
| 1780 | <p>2.3.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.3.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1790 | <p>2.3.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1800 | <p>2.3.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.3.4. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1810 | <p>2.3.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1820 | <p>2.3.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.3.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1830 | <p>2.3.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> |

| | |
|------|---|
| | Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 1840 | <p>2.3.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.3.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1850 | <p>2.3.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1860 | <p>2.3.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.3.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1870 | <p>2.3.8. Nicht liquide Aktiva</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut Aktiva der Stufe 2A (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1880 | <p>2.3.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.3.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde;</p> |
| 1890 | <p>2.4. Summe der Transaktionen, bei denen forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> |

| | |
|------|---|
| | Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenwaps für Transaktionen, bei denen forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) verliehen wurden. |
| 1900 | <p>2.4.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1910 | <p>2.4.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.4.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1920 | <p>2.4.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1930 | <p>2.4.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.4.2. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1940 | <p>2.4.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1950 | <p>2.4.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.4.3. melden die Kreditinstitute</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1960 | <p>2.4.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1970 | <p>2.4.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.4.4. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 1980 | <p>2.4.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 1990 | <p>2.4.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.4.5. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2000 | <p>2.4.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder</p> |

| | |
|------|---|
| | natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 2010 | <p>2.4.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.4.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2020 | <p>2.4.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2030 | <p>2.4.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.4.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2040 | <p>2.4.8. Nicht liquide Aktiva</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2050 | <p>2.4.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.4.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde;</p> |
| 2060 | <p>2.5. Summe der Transaktionen, bei denen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenswaps für Transaktionen, bei denen</p> |

| | |
|------|---|
| | gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B verliehen wurden. |
| 2070 | <p>2.5.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2080 | <p>2.5.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.5.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2090 | <p>2.5.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2100 | <p>2.5.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.5.2. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2110 | <p>2.5.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2120 | <p>2.5.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.5.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2130 | <p>2.5.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2140 | <p>2.5.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.5.4. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2150 | <p>2.5.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2160 | <p>2.5.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.5.5. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2170 | <p>2.5.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |

| | |
|------|---|
| 2180 | <p>2.5.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.5.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2190 | <p>2.5.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2200 | <p>2.5.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.5.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2210 | <p>2.5.8. Nicht liquide Aktiva</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2220 | <p>2.5.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.5.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde;</p> |
| 2230 | <p>2.6. Summe der Transaktionen, bei denen forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenwaps für Transaktionen, bei denen</p> |

| | |
|------|--|
| | forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) verliehen wurden. |
| 2240 | <p>2.6.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2250 | <p>2.6.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.6.1. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2260 | <p>2.6.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2270 | <p>2.6.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.6.2. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2280 | <p>2.6.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2290 | <p>2.6.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> |

| | |
|------|---|
| | <p>Für die Geschäfte unter 2.6.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2300 | <p>2.6.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2310 | <p>2.6.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.6.4. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2320 | <p>2.6.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2330 | <p>2.6.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.6.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2340 | <p>2.6.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> |

| | |
|------|---|
| | Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 2350 | <p>2.6.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.6.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2360 | <p>2.6.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2370 | <p>2.6.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.6.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2380 | <p>2.6.8. Nicht liquide Aktiva</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut forderungsbesicherte Wertpapiere der Stufe 2B (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2390 | <p>2.6.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.6.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde;</p> |
| 2400 | 2.7. Summe der Transaktionen, bei denen andere Aktiva der Stufe 2B verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden: |

| | |
|------|--|
| | <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheitenwaps für Transaktionen, bei denen andere Aktiva der Stufe 2B verliehen wurden.</p> |
| 2410 | <p>2.7.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2420 | <p>2.7.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.7.1. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2430 | <p>2.7.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2440 | <p>2.7.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.7.2. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2450 | <p>2.7.3. Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2460 | <p>2.7.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.7.3. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2470 | <p>2.7.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2480 | <p>2.7.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.7.4. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2490 | <p>2.7.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2500 | <p>2.7.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.7.5. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2510 | <p>2.7.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2520 | <p>2.7.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.7.6. melden die Kreditinstitute</p> |

| | |
|------|--|
| | <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2530 | <p>2.7.7. Andere Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2540 | <p>2.7.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.7.7. melden die Kreditinstitute</p> <p>die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde; und</p> <p>die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt.</p> |
| 2550 | <p>2.7.8. Nicht liquide Aktiva</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut andere Aktiva der Stufe 2B (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2560 | <p>2.7.8.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> <p>Für die Geschäfte unter 2.7.8. melden die Kreditinstitute die Komponente der verliehenen Sicherheit, die — würde sie nicht als Sicherheit bei diesen Geschäften verwendet — nach Artikel 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 als liquides Aktivum gelten würde;</p> |
| 2570 | <p>2.8. Summe der Transaktionen, bei denen nicht liquide Aktiva verliehen und folgende Sicherheiten geliehen wurden:</p> <p>Artikel 28 Absatz 4 und Artikel 32 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Die Kreditinstitute melden hier für die betreffenden Spalten die Gesamtwerte der Sicherheiten-swaps für Transaktionen, bei denen nicht liquide Aktiva verliehen wurden.</p> |
| 2580 | <p>2.8.1. Aktiva der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität)</p> <p>Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, (geliehen) getauscht hat.</p> |
| 2590 | <p>2.8.1.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen</p> |

| | |
|------|--|
| | Für die Geschäfte unter 2.8.1. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 2600 | 2.8.2. Stufe 1: gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 (geliehen) getauscht hat. |
| 2610 | 2.8.2.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.8.2. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 2620 | 2.8.3. Aktiva der Stufe 2A Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen Aktiva der Stufe 2A (geliehen) getauscht hat. |
| 2630 | 2.8.3.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.8.3. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 2640 | 2.8.4. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Wohnimmobilien oder Kfz, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 2650 | 2.8.4.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.8.4. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 2660 | 2.8.5. Stufe 2B: gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen gedeckte Schuldverschreibungen hoher Qualität der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 2670 | 2.8.5.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.8.5. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 2680 | 2.8.6. Stufe 2B: forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) |

| | |
|----------------------------|--|
| | Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen forderungsbesicherte Wertpapiere (Gewerbe oder natürliche Personen, Mitgliedstaat, Bonitätsstufe 1) der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 2690 | 2.8.6.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.8.6. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 2700 | 2.8.7. Andere Aktiva der Stufe 2B Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen andere Aktiva der Stufe 2B (geliehen) getauscht hat. |
| 2710 | 2.8.7.1. Davon: Getauschte Sicherheiten erfüllen die operativen Anforderungen Für die Geschäfte unter 2.8.7. melden die Kreditinstitute die Komponente der geliehenen Sicherheit, wenn sie die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllt. |
| 2720 | 2.8.8. Nicht liquide Aktiva Transaktionen, bei denen das Kreditinstitut nicht liquide Aktiva (verliehen) gegen nicht liquide Aktiva (geliehen) getauscht hat. |
| ZUSATZINFORMATIONEN | |
| 2730 | 3. Summe der Sicherheitenswaps (alle Gegenparteien), bei denen geliehene Sicherheiten zur Deckung von Leerverkaufspositionen eingesetzt wurden Die Kreditinstitute melden hier die Summe der in den obigen Zeilen ausgewiesenen Sicherheitenswaps (alle Gegenparteien), bei denen geliehene Sicherheiten zur Deckung von Leerverkaufspositionen eingesetzt wurden, wobei eine Abflussrate von 0 % angesetzt wurde. |
| 2740 | 4. Summe der Sicherheitenswaps mit gruppeninternen Gegenparteien Die Kreditinstitute melden hier die Summe der in den obigen Zeilen ausgewiesenen Sicherheitenswaps mit gruppeninternen Gegenparteien. |
| | 5. Von Artikel 17 Absätze 2 und 3 freigestellte Sicherheitenswaps Hier melden die Kreditinstitute den Teil der Sicherheitenswaps mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, bei denen die Gegenpartei eine Zentralbank ist und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind. |
| 2750 | 5.1. davon: bei geliehener Sicherheit handelt es sich um Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität Hier melden die Kreditinstitute den Teil der Sicherheitenswaps mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist, es sich bei den geliehenen Sicherheiten um Sicherheiten |

| | |
|------|--|
| | <p>der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 2760 | <p>5.2. davon: bei geliehener Sicherheit handelt es sich um gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den Teil der Sicherheitenwaps mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist, es sich bei den geliehenen Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 2770 | <p>5.3. davon: bei geliehener Sicherheit handelt es sich um Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den Teil der Sicherheitenwaps mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist, es sich bei den geliehenen Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 2A handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 2780 | <p>5.4. davon: bei geliehener Sicherheit handelt es sich um Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den Teil der Sicherheitenwaps mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist, es sich bei den geliehenen Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 2B handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 2790 | <p>5.5. davon: bei verliehener Sicherheit handelt es sich um Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den Teil der Sicherheitenwaps mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist, es sich bei den verliehenen Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU)</p> |

| | |
|------|--|
| | 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind. |
| 2800 | <p>5.6. davon: bei verliehener Sicherheit handelt es sich um gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den Teil der Sicherheitenwaps mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist, es sich bei den verliehenen Sicherheiten um gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 2810 | <p>5.7. davon: bei verliehener Sicherheit handelt es sich um Aktiva der Stufe 2A</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den Teil der Sicherheitenwaps mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist, es sich bei den verliehenen Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 2A handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |
| 2820 | <p>5.8. davon: bei verliehener Sicherheit handelt es sich um Aktiva der Stufe 2B</p> <p>Hier melden die Kreditinstitute den Teil der Sicherheitenwaps mit einer Restlaufzeit von höchstens 30 Tagen, wobei die Gegenpartei eine Zentralbank ist, es sich bei den verliehenen Sicherheiten um Sicherheiten der Stufe 2B handelt, die die operativen Anforderungen des Artikels 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 erfüllen, und die betreffenden Geschäfte nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 von der Anwendung des Artikels 17 Absätze 2 und 3 der genannten Verordnung freigestellt sind.</p> |

TEIL 5: BERECHNUNGEN

1. Berechnungen

1.1. Allgemeine Bemerkungen

1. Dies ist ein zusammenfassender Meldebogen mit Angaben zu den Berechnungen zwecks Meldung der Liquiditätsdeckungsanforderung gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61. Posten, zu denen die Institute keine Angaben machen müssen, sind grau hinterlegt.

1.2. Besondere Bemerkungen

2. Verweise auf Zellen haben das folgende Format: Meldebogen; Zeile; Spalte. Beispielsweise bezieht sich {C 72.00; r0130; c0040} auf Meldebogen für liquide Aktiva; Zeile 0130; Spalte 0040.

1.3. Einzelbogen Berechnungen – Erläuterungen zu den einzelnen Zeilen

| Zeile | Rechtsgrundlagen und Erläuterungen |
|--|--|
| BERECHNUNGEN | |
| Zähler, Nenner, Verhältnis | |
| Artikel 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Zähler, Nenner und Verhältnis der Liquiditätsdeckungsquote. Tragen Sie alle nachfolgenden Daten in Spalte 0010 der angegebenen Zeile ein. | |
| 0010 | 1. Liquiditätspuffer Die Institute melden den Zahlenwert aus {C 76.00; r0290; c0010}. |
| 0020 | 2. Netto-Liquiditätsabfluss Die Institute melden den Zahlenwert aus {C 76.00; r0370; c0010}. |
| 0030 | 3. Liquiditätsdeckungsquote (%) Die Institute melden die Liquiditätsdeckungsquote, die gemäß Artikel 4 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 berechnet wurde. Die Liquiditätsdeckungsquote entspricht dem Verhältnis des Liquiditätspuffers eines Kreditinstituts zu seinen Netto-Liquiditätsabflüssen während einer Stressphase von 30 Kalendertagen und wird als Prozentsatz angegeben. Wenn {C 76.00; r0020; c0010} gleich null (was ein Verhältnis von unendlich ergibt), dann ist der Wert 999999 zu melden. |
| Berechnungen des Zählers | |
| Artikel 17 und Anhang I der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 Formel für die Berechnung des Liquiditätspuffers Tragen Sie alle nachfolgenden Daten in Spalte 0010 der angegebenen Zeile ein. | |
| 0040 | 4. Liquiditätspuffer der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität (Wert gemäß Artikel 9): unbereinigt Die Institute melden den Zahlenwert aus {C 72.00; r0030; c0040}.. |

| | |
|------|---|
| 0050 | <p>5. Abflüsse der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden</p> <p>Die Institute melden Abflüsse aus liquiden Wertpapieren der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität) nach Abwicklung aller besicherten Finanzierungsgeschäfte, besicherten Leihgeschäfte oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Stichtag fällig werden, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0060 | <p>6. Zuflüsse der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden</p> <p>Die Institute melden Zuflüsse aus liquiden Wertpapieren der Stufe 1 (ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität) nach Abwicklung aller besicherten Finanzierungsgeschäfte, besicherten Leihgeschäfte oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Stichtag fällig werden, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0070 | <p>7. Besicherte Liquiditätsabflüsse</p> <p>Die Institute melden Liquiditätsabflüsse (Aktiva der Stufe 1) nach Abwicklung aller besicherten Finanzierungsgeschäfte oder besicherten Leihgeschäfte, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Stichtag fällig werden, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0080 | <p>8. Besicherte Liquiditätszuflüsse</p> <p>Die Institute melden Liquiditätszuflüsse (Aktiva der Stufe 1) nach Abwicklung aller besicherten Finanzierungsgeschäfte oder besicherten Leihgeschäfte, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Stichtag fällig werden, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0091 | <p>9. Aktiva der Stufe 1, ausgenommen gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität: „bereinigter Betrag“</p> <p>Dies entspricht Anhang I Ziffer 3 Buchstabe a.</p> <p>Die Institute melden den bereinigten Betrag nicht gedeckter Schuldverschreibungen der Stufe 1 vor Anwendung der Obergrenze.</p> <p>Bei dem bereinigten Betrag ist die Abwicklung von besicherten Finanzierungsgeschäften, besicherten Leihgeschäften oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Stichtag fällig werden, zu berücksichtigen, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0100 | <p>10. Wert von gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 gemäß Artikel 9: unbereinigt</p> <p>Die Institute melden den Zahlenwert aus {C 72.00; r0180; c0040}.</p> |

| | |
|------|---|
| 0110 | <p>11. Abflüsse aus gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden</p> <p>Die Institute melden Abflüsse aus gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 nach Abwicklung aller besicherten Finanzierungsgeschäfte, besicherten Leihgeschäfte oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Stichtag fällig werden, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0120 | <p>12. Zuflüsse aus gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden</p> <p>Die Institute melden Zuflüsse aus gedeckten Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1 nach Abwicklung aller besicherten Finanzierungsgeschäfte, besicherten Leihgeschäfte oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Stichtag fällig werden, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0131 | <p>13. Gedeckte Schuldverschreibungen äußerst hoher Qualität der Stufe 1: „bereinigter Betrag“</p> <p>Dies entspricht Anhang I Ziffer 3 Buchstabe b.</p> <p>Die Institute melden den bereinigten Betrag gedeckter Schuldverschreibungen der Stufe 1 vor Anwendung der Obergrenze.</p> <p>Bei dem bereinigten Betrag wird die Abwicklung von besicherten Finanzierungsgeschäften, besicherten Leihgeschäften oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Stichtag fällig werden, berücksichtigt, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0160 | <p>14. Wert von Aktiva der Stufe 2A gemäß Artikel 9: unbereinigt</p> <p>Die Institute melden den Zahlenwert aus {C 72.00; r0230; c0040}.</p> |
| 0170 | <p>15. Abflüsse aus Sicherheiten der Stufe 2A, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden</p> <p>Die Institute melden Abflüsse aus liquiden Wertpapieren der Stufe 2A nach Abwicklung aller besicherten Finanzierungsgeschäfte, besicherten Leihgeschäfte oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Berechnungsdatum fällig werden, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0180 | <p>16. Zuflüsse aus Sicherheiten der Stufe 2A, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden</p> <p>Die Institute melden Zuflüsse aus liquiden Wertpapieren der Stufe 2A nach Abwicklung aller besicherten Finanzierungsgeschäfte, besicherten Leihgeschäfte oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Berechnungsdatum fällig werden, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |

| | |
|------|---|
| 0191 | <p>17. Aktiva der Stufe 2A: „bereinigter Betrag“</p> <p>Dies entspricht Anhang I Ziffer 3 Buchstabe c.</p> <p>Die Institute melden den bereinigten Betrag von Aktiva der Stufe 2A vor Anwendung der Obergrenze.</p> <p>Bei dem bereinigten Betrag wird die Abwicklung von besicherten Finanzierungsgeschäften, besicherten Leihgeschäften oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Berechnungsdatum fällig werden, berücksichtigt, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0220 | <p>18. Wert von Aktiva der Stufe 2B gemäß Artikel 9: unbereinigt</p> <p>Die Institute melden den Zahlenwert aus {C 72.00; r0310; c0040}.</p> |
| 0230 | <p>19. Abflüsse aus Sicherheiten der Stufe 2B, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden</p> <p>Die Institute melden Abflüsse aus liquiden Wertpapieren der Stufe 2B nach Abwicklung aller besicherten Finanzierungsgeschäfte, besicherten Leihgeschäfte oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Berechnungsdatum fällig werden, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0240 | <p>20. Zuflüsse aus Sicherheiten der Stufe 2B, die innerhalb von 30 Kalendertagen fällig werden</p> <p>Die Institute melden Zuflüsse aus liquiden Wertpapieren der Stufe 2B nach Abwicklung aller besicherten Finanzierungsgeschäfte, besicherten Leihgeschäfte oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Berechnungsdatum fällig werden, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0251 | <p>21. Aktiva der Stufe 2B: „bereinigter Betrag“</p> <p>Dies entspricht Anhang I Ziffer 3 Buchstabe d.</p> <p>Die Institute melden den bereinigten Betrag von Aktiva der Stufe 2B vor Anwendung der Obergrenze.</p> <p>Bei dem bereinigten Betrag wird die Abwicklung von besicherten Finanzierungsgeschäften, besicherten Leihgeschäften oder Sicherheitenswaps, die innerhalb von 30 Kalendertagen nach dem Berechnungsdatum fällig werden, berücksichtigt, außer wenn das Geschäft nach Artikel 17 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61 freigestellt ist.</p> |
| 0280 | <p>22. Betrag der überschüssigen liquiden Aktiva</p> <p>Anhang I Ziffer 4</p> <p>Die Institute melden den „Betrag der überschüssigen liquiden Aktiva“. Dieser Betrag ist gleich:</p> |

| | |
|---|--|
| | <p>a) dem bereinigten Betrag nicht gedeckter Schuldverschreibungen der Stufe 1 zuzüglich</p> <p>b) des bereinigten Betrags gedeckter Schuldverschreibungen der Stufe 1 zuzüglich</p> <p>c) des bereinigten Betrags der Aktiva der Stufe 2A zuzüglich</p> <p>d) des bereinigten Betrags der Aktiva der Stufe 2B</p> <p>abzüglich des niedrigsten Werts von:</p> <p>e) der Summe aus a, b, c und d;</p> <p>f) 100/30 multipliziert mit a;</p> <p>g) 100/60 multipliziert mit der Summe aus a und b;</p> <p>h) 100/85 multipliziert mit der Summe aus a, b und c.</p> |
| 0290 | <p>23. LIQUIDITÄTSPUFFER</p> <p>Anhang I Ziffer 2</p> <p>Die Institute melden den Liquiditätspuffer. Dieser ist gleich:</p> <p>a) dem Betrag der Aktiva der Stufe 1 zuzüglich</p> <p>b) des Betrags der Aktiva der Stufe 2A zuzüglich</p> <p>c) des Betrags der Aktiva der Stufe 2B</p> <p>abzüglich des niedrigsten Werts von:</p> <p>d) der Summe aus a, b und c oder</p> <p>e) dem „Betrag der überschüssigen liquiden Aktiva“.</p> |
| <p>Berechnungen des Nenners</p> <p>Anhang II der Delegierten Verordnung (EU) 2015/61</p> <p>Formel für die Berechnung des Netto-Liquiditätsabflusses</p> <p>Dabei gilt:</p> <p>NLO = Netto-Liquiditätsabfluss</p> <p>TO = Gesamtabflüsse</p> <p>TI = Gesamtzuflüsse</p> <p>FEI = Vollständig ausgenommene Zuflüsse</p> <p>IHC = Zuflüsse mit höherer Obergrenze von 90 % der Abflüsse</p> <p>IC = Zuflüsse mit Obergrenze von 75 % der Abflüsse</p> <p>Die Institute tragen alle nachfolgenden Daten in Spalte 0010 der angegebenen Zeile ein.</p> | |
| 0300 | <p>24. Gesamtabflüsse</p> <p>TO = aus Meldebogen Abflüsse</p> <p>Die Institute melden den Zahlenwert aus {C 73.00; r0010; c0060}.</p> |
| 0310 | <p>25. Vollständig ausgenommene Zuflüsse</p> |

| | |
|----------------|--|
| | FEI = aus Meldebogen Zuflüsse Die Institute melden den Zahlenwert aus {C 74.00; r0010; c0160}. |
| 0320 | 26. Zuflüsse mit der Obergrenze von 90 % IHC = aus Meldebogen Zuflüsse Die Institute melden den Zahlenwert aus {C 74.00; r0010; c0150}. |
| 0330 | 27. Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 % IC = aus Meldebogen Zuflüsse Die Institute melden den Zahlenwert aus {C 74.00; r0010; c0140}. |
| 0340 | 28. Abschläge für vollständig ausgenommene Zuflüsse Die Institute melden den nachfolgenden Teil der Berechnung von NLO: = MIN (FEI, TO). |
| 0350 | 29. Abschläge für Zuflüsse mit der Obergrenze von 90 % Die Institute melden den nachfolgenden Teil der Berechnung von NLO: = MIN (IHC, 0.9*MAX(TO-FEI, 0)). |
| 0360 | 30. Abschläge für Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 % Die Institute melden den nachfolgenden Teil der Berechnung von NLO: = MIN (IC, 0.75*MAX(TO-FEI-IHC/0.9, 0)). |
| 0370 | 31. NETTO-LIQUIDITÄTSABFLUSS Die Institute melden den Netto-Liquiditätsabfluss, der der Gesamtsumme der Abflüsse abzüglich der Abschläge für vollständig ausgenommene Zuflüsse abzüglich der Abschläge für Zuflüsse mit der Obergrenze von 90 % abzüglich der Abschläge für Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 % entspricht. NLO = TO — MIN(FEI, TO) - MIN(IHC, 0.9*MAX(TO-FEI, 0)) - MIN(IC, 0.75*MAX(TO-FEI-IHC/0.9,0)) |
| Säule 2 | |
| 0380 | 32. ANFORDERUNG NACH SÄULE 2 Artikel 105 CRD Die Institute melden die Anforderung nach Säule 2. |

TEIL 6: KONSOLIDIERUNGSKREIS

1. Konsolidierungskreis

1.1. Allgemeine Bemerkungen

1. Dieser Meldebogen enthält — einzig für die Zwecke der LCR auf konsolidierter Ebene — Angaben zu den Unternehmen, auf die sich die in den Meldebögen C 72.00, C 73.00, C 74.00, C 75.01 und C 76.00 gemeldeten Informationen beziehen. In diesem Meldebogen werden alle Unternehmen angegeben, die — je nach Anwendbarkeit — gemäß den Artikeln 8 und 10

sowie Artikel 11 Absätze 3 und 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 zum Konsolidierungskreis gehören. Dieser Meldebogen hat ebenso viele Zeilen wie die Zahl der Unternehmen, die zum Konsolidierungskreis gehören.

1.2 Erläuterungen zu bestimmten Spalten

| Spalte | Rechtsgrundlagen und Erläuterungen |
|---------------|--|
| 0005 | <p>Mutter- oder Tochterunternehmen</p> <p>Anzugeben ist „Mutterunternehmen“, falls es sich bei dem in der betreffenden Zeile genannten Unternehmen um Folgendes handelt:</p> <ul style="list-style-type: none"> • das EU-Mutterinstitut, die EU-Mutterfinanzholdinggesellschaft oder eine gemischte EU-Mutterfinanzholdinggesellschaft im Sinne des Artikels 11 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013; • das Mutterinstitut oder ein Tochterinstitut, das die LCR im Rahmen einer zusammengefassten Liquiditätsuntergruppe gemäß Artikel 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 auf konsolidierter Basis bzw. auf teilkonsolidierter Basis einhalten muss; • das betreffende Institut, das die LCR gemäß Artikel 11 Absatz 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 auf teilkonsolidierter Basis einhalten muss; • das EU-Zentralinstitut. <p>In den übrigen Zeilen ist „Tochterunternehmen“ anzugeben.</p> |
| 0010 | <p>Name</p> <p>In Zeile 0010 wird der Name jedes Unternehmens im Konsolidierungskreis angegeben.</p> |
| 0020 | <p>Code</p> <p>Der Code ist Teil der Zeilenkennung und muss für jedes meldende Unternehmen einmalig vergeben worden sein. Bei Instituten und Versicherungsunternehmen entspricht der Code dem LEI-Code. Bei sonstigen Unternehmen entspricht der Code dem LEI-Code oder, falls kein LEI-Code vorliegt, einem nationalen Code. Der Code muss einmalig vergeben worden sein und muss durchgängig und dauerhaft in allen Meldebögen verwendet werden. Das Codefeld muss immer ausgefüllt sein.</p> |
| 0021 | <p>Art des Codes</p> <p>Die Institute müssen angeben, welche Art von Code in Spalte 0020 angegeben wird: „LEI-Code“ oder „Kein LEI-Code“.</p> <p>Die Art des Codes ist stets anzugeben.</p> |
| 0022 | <p>Nationaler Code</p> <p>Wenn in der Spalte „Code“ der „LEI-Code“ angegeben wurde, können die Institute den nationalen Code zusätzlich angeben.</p> |
| 0040 | <p>Ländercode</p> <p>In Zeile 0020 wird der Ländercode des Sitzlandes jedes Unternehmens im Konsolidierungskreis nach ISO-Standard 3166-1-Alpha-2 angegeben.</p> |
| 0050 | <p>Art des Unternehmens</p> |

| | |
|--|--|
| | <p>Bei jedem in Spalte 0010 genannten Unternehmen ist anzugeben, um welche Art von Unternehmen es sich handelt. Wählen Sie je nach Rechtsform:</p> <p>„Kreditinstitut“; „Wertpapierfirma“; „Sonstige“.</p> |
|--|--|